공시일	2018-02-07
기준일	2018-02-06

포커스농산물모(채권-파생평)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	8	0	8	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2018-02-07
기준일	2018-02-06

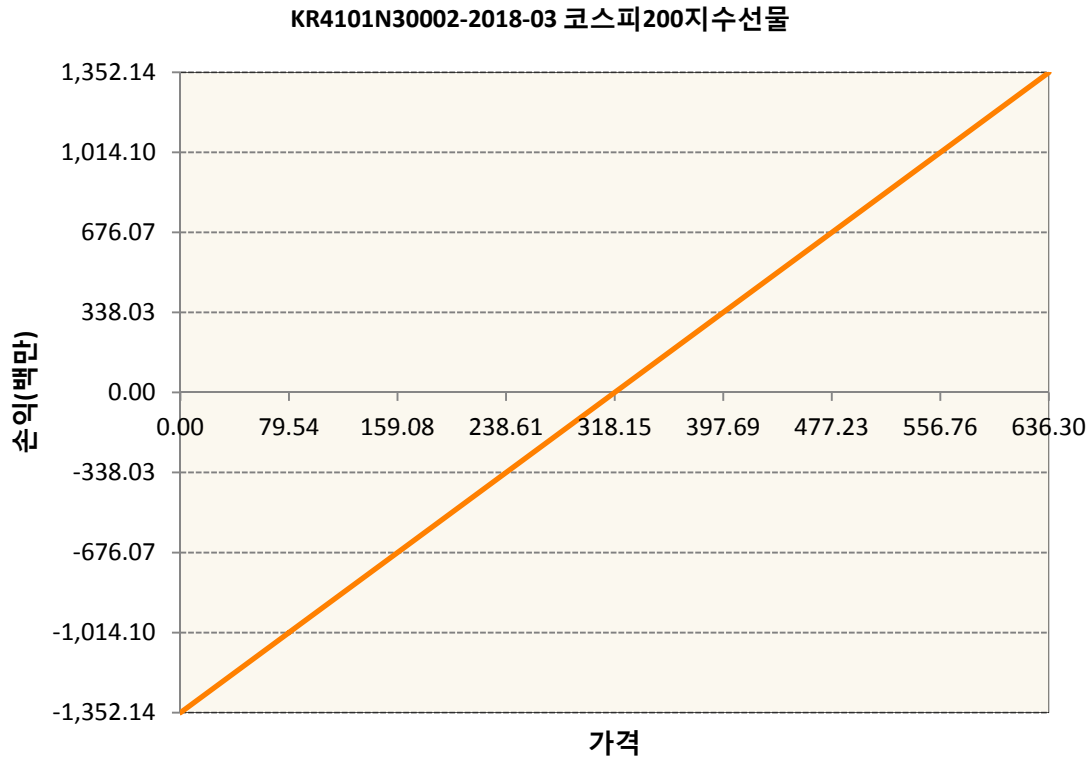
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,352	0	1,352	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							108
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-108	-108	-108	-108	-108	-108	-108
-5.33%	-72	-72	-72	-72	-72	-72	-72
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	36	36	36	36	36	36	36
5.33%	72	72	72	72	72	72	72
8.00%	108	108	108	108	108	108	108

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

68

공시일	2018-02-07
기준일	2018-02-06

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	13,365	0	13,365	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S171122	1,102

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

379

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-07
기준일	2018-02-06

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,901	0	4,901	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S171208	384

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

350

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-07
기준일	2018-02-06

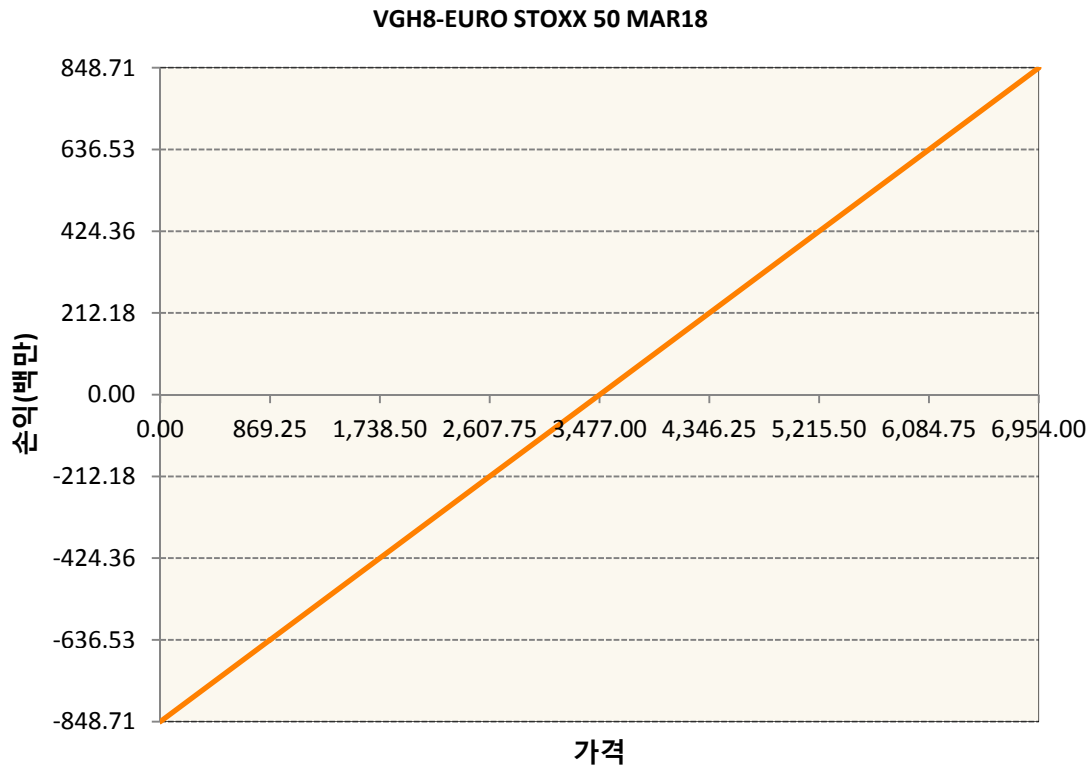
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	849	0	849	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	68

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

38

공시일	2018-02-07
기준일	2018-02-06

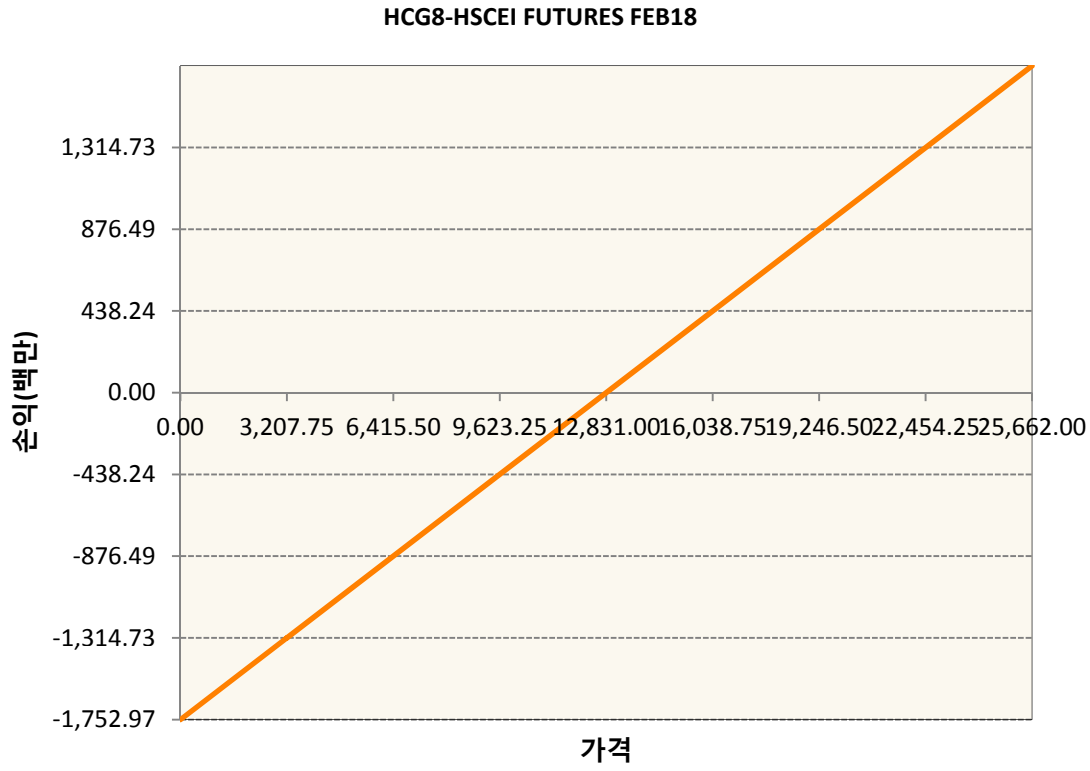
차이나인덱스모(주식-파생형)

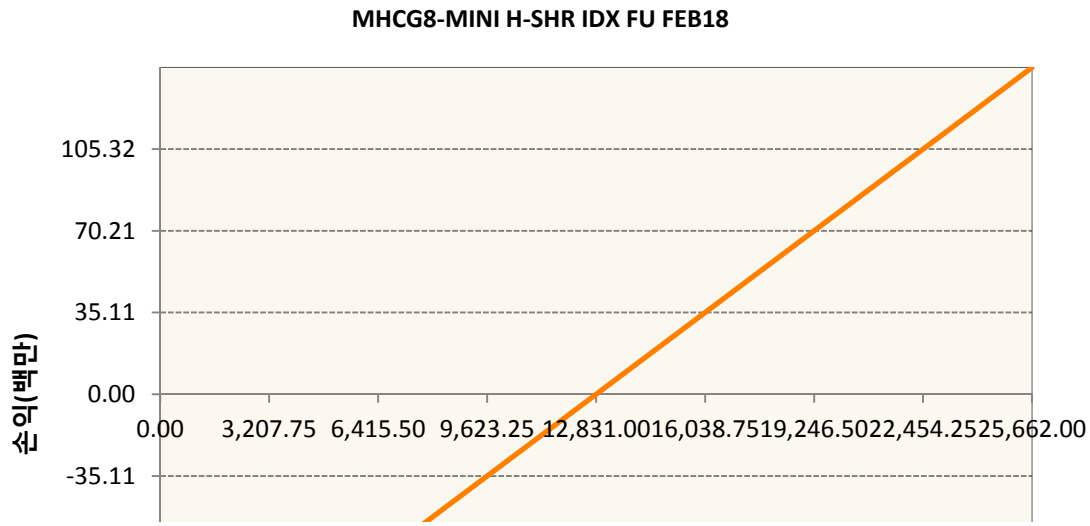
1. 계약금액

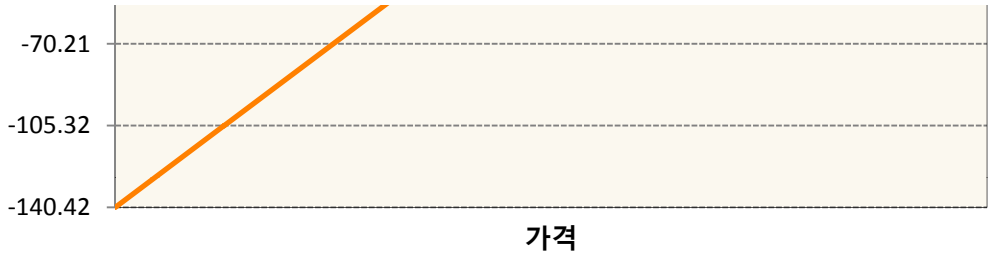
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,893	0	1,893	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	140
MHCG8	MINI H-SHR IDX FU FEB18	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	123

공시일	2018-02-07
기준일	2018-02-06

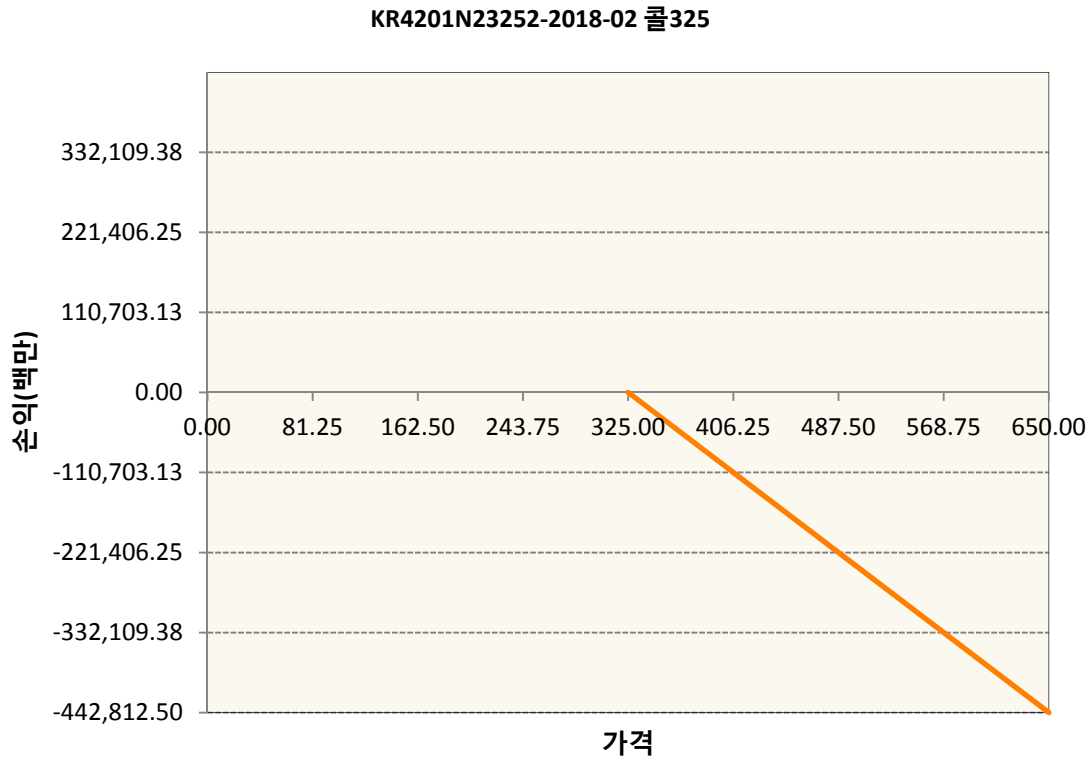
커버드콜모(주식혼합-파생형)

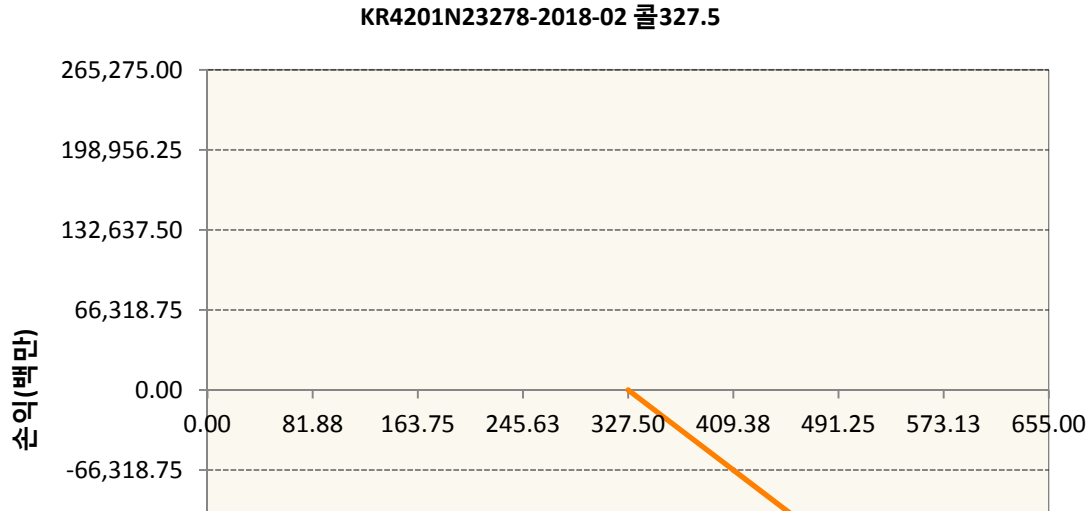
1. 계약금액

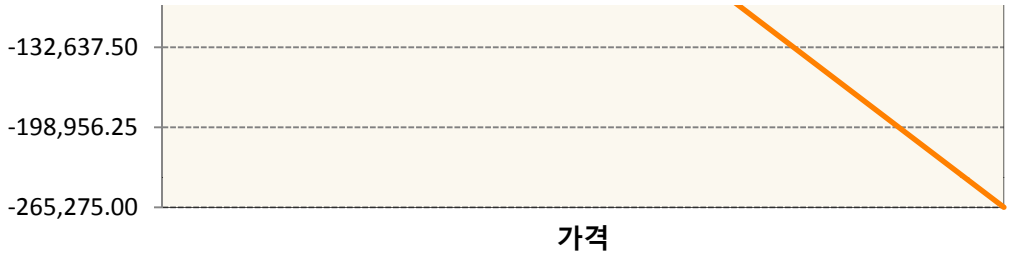
(단위:백만원)

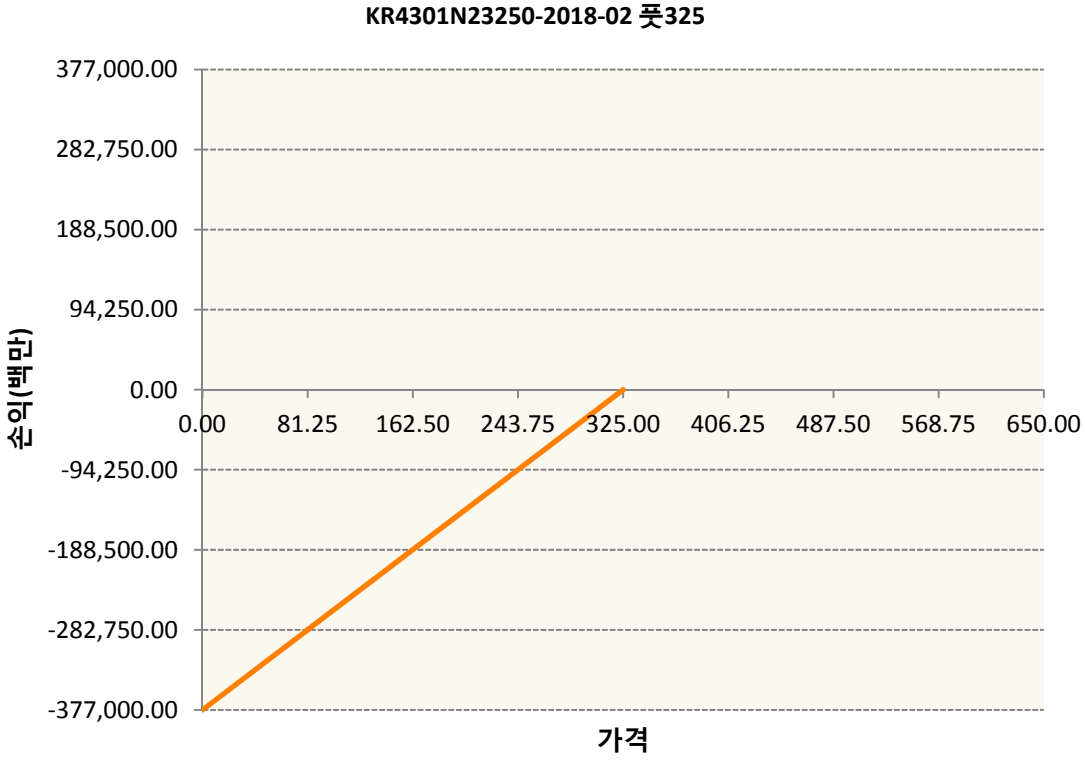
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	9,287	0	9,287	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,199,713	-1,199,713	장내

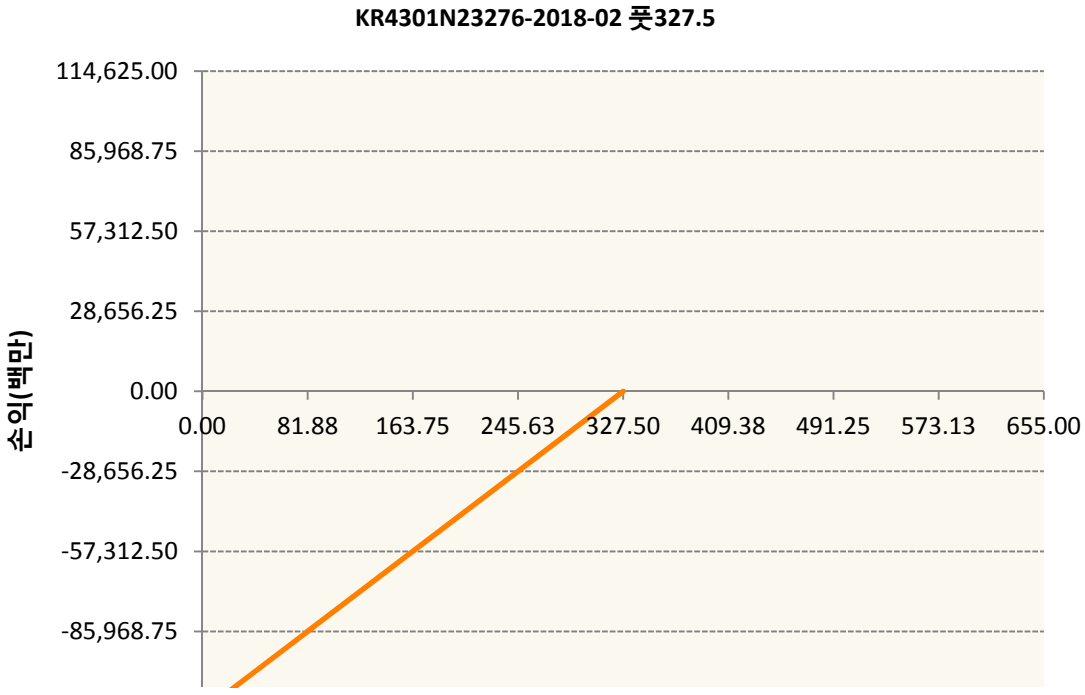
2. 만기시점의 손익구조






-132,637.50
-198,956.25
-265,275.00
가격


KR4301N23250-2018-02 풋325
377,000.00
282,750.00
188,500.00
94,250.00
0.00
-94,250.00
-188,500.00
-282,750.00
-377,000.00
0.00
81.25
162.50
243.75
325.00
406.25
487.50
568.75
650.00
손익(백만)
가격


KR4301N23276-2018-02 풋327.5
114,625.00
85,968.75
57,312.50
28,656.25
0.00
-28,656.25
-57,312.50
-85,968.75
0.00
81.88
163.75
245.63
327.50
409.38
491.25
573.13
655.00
손익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4201N232 2018-02 콜325							24,635
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	553	553	553	553	553	553	553
-5.33%	553	553	553	553	553	552	551
-2.67%	552	551	546	537	523	500	469
0%	367	264	141	0	-157	-328	-510
2.67%	-3,160	-3,432	-3,707	-3,983	-4,261	-4,539	-4,819
5.33%	-13,084	-13,125	-13,183	-13,259	-13,352	-13,462	-13,586
8.00%	-24,594	-24,594	-24,596	-24,599	-24,606	-24,617	-24,635
KR4201N232 2018-02 콜327.5							12,844
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	141	141	141	141	141	141	141
-5.33%	141	141	141	141	141	141	141
-2.67%	141	141	140	138	135	129	120
0%	111	85	48	0	-58	-125	-201
2.67%	-1,018	-1,184	-1,352	-1,519	-1,688	-1,856	-2,024
5.33%	-6,015	-6,073	-6,143	-6,225	-6,317	-6,417	-6,525
8.00%	-12,784	-12,786	-12,789	-12,795	-12,806	-12,822	-12,844
KR4301N232 2018-02 풋325							29,398
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-29,398	-29,398	-29,398	-29,398	-29,398	-29,398	-29,398
-5.33%	-19,562	-19,562	-19,562	-19,562	-19,562	-19,562	-19,562
-2.67%	-9,725	-9,725	-9,725	-9,725	-9,726	-9,727	-9,729
0%	90	70	40	0	-50	-109	-176
2.67%	7,407	7,254	7,098	6,940	6,780	6,619	6,458
5.33%	8,209	8,206	8,200	8,189	8,173	8,150	8,120
8.00%	8,211	8,211	8,211	8,211	8,211	8,211	8,210
KR4301N232 2018-02 풋327.5							8,896
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-8,896	-8,896	-8,896	-8,896	-8,896	-8,896	-8,896
-5.33%	-5,928	-5,928	-5,928	-5,928	-5,928	-5,928	-5,928
-2.67%	-2,960	-2,960	-2,960	-2,960	-2,960	-2,960	-2,960
0%	7	6	4	0	-6	-13	-23
2.67%	2,671	2,622	2,572	2,523	2,473	2,423	2,373

5.33%	3,321	3,316	3,308	3,297	3,283	3,266	3,246
8.00%	3,326	3,326	3,326	3,326	3,326	3,326	3,325

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

79,322

공시일	2018-02-07
기준일	2018-02-06

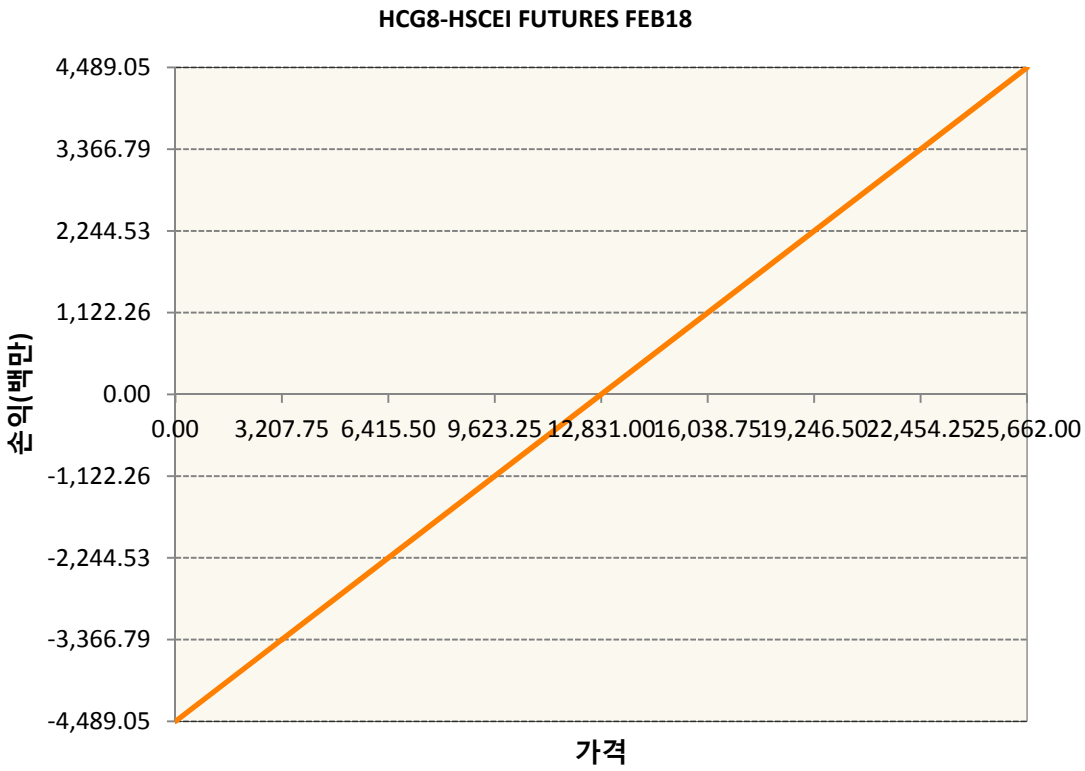
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

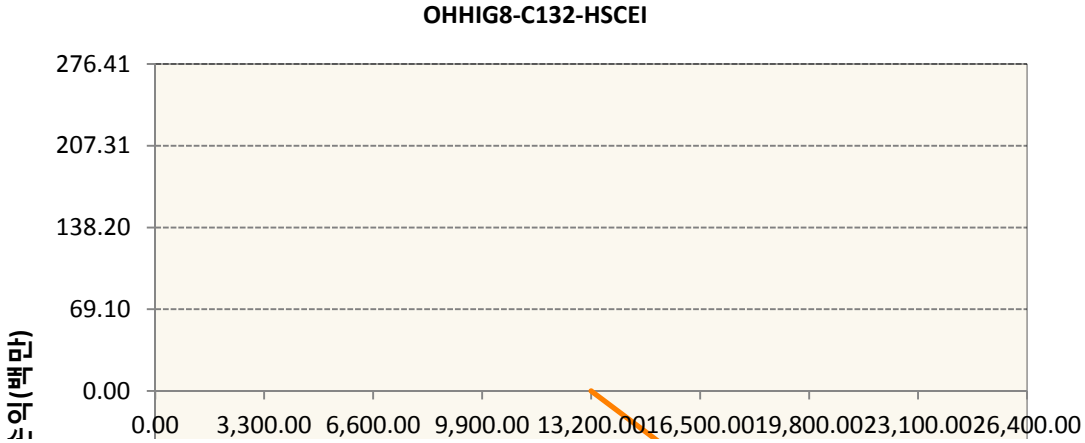
1. 계약금액

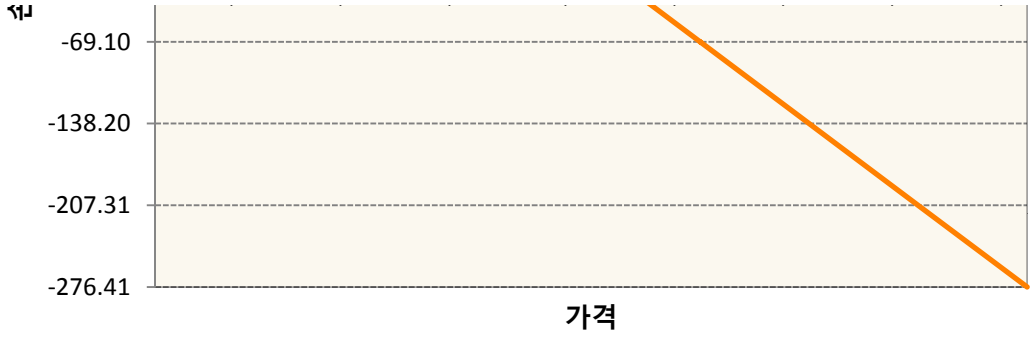
(단위:백만원)

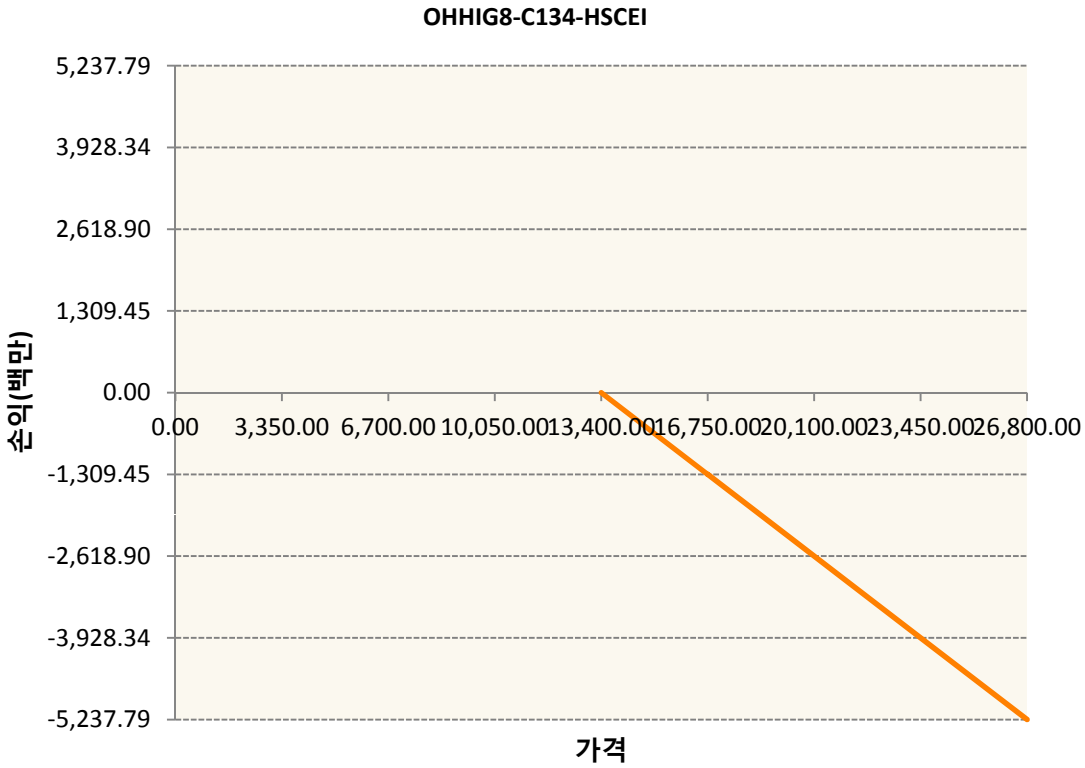
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4,489	0	4,489	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,028	-11,028	장내

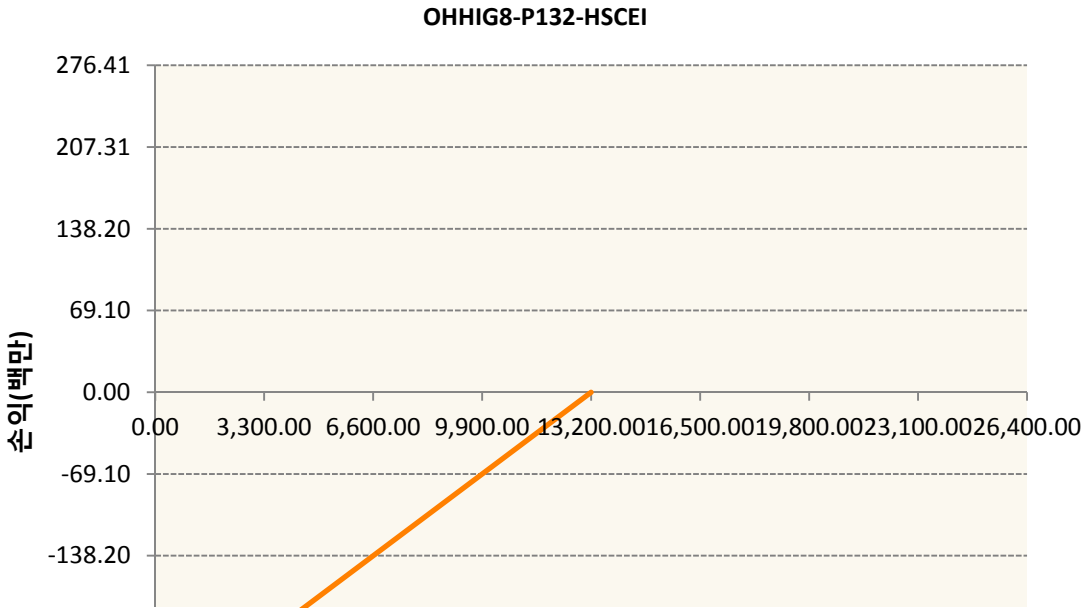
2. 만기시점의 손익구조

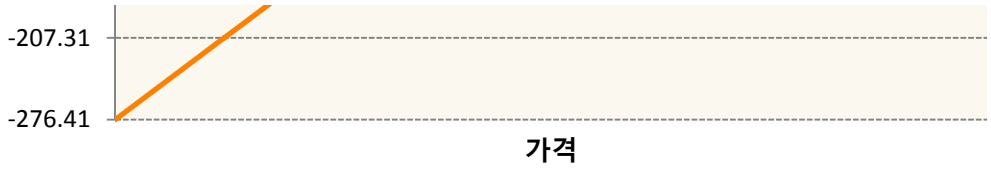


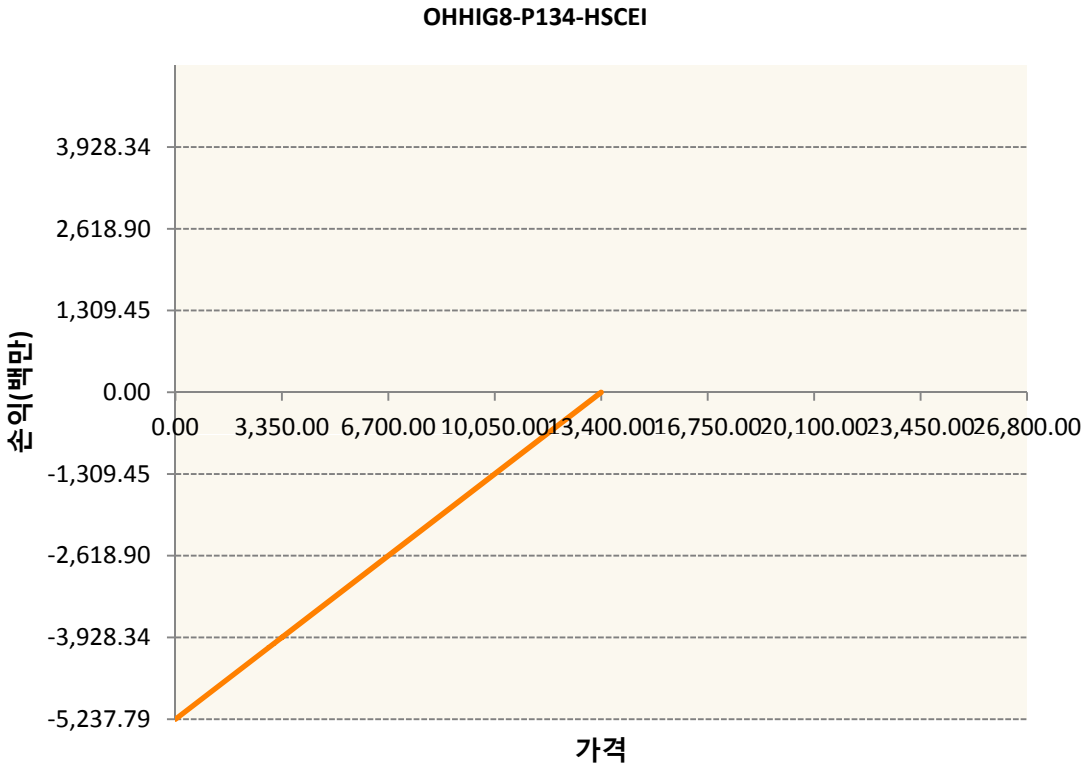



-69.10
-138.20
-207.31
-276.41
가격


OHHIG8-C134-HSCEI
5,237.79
3,928.34
2,618.90
1,309.45
0.00
-1,309.45
-2,618.90
-3,928.34
-5,237.79
0.00
3,350.00
6,700.00
10,050.00
13,400.00
16,750.00
20,100.00
23,450.00
26,800.00
손익(백만)
가격


OHHIG8-P132-HSCEI
276.41
207.31
138.20
69.10
0.00
-69.10
-138.20
0.00
3,300.00
6,600.00
9,900.00
13,200.00
16,500.00
19,800.00
23,100.00
26,400.00
손익(백만)





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
HCG8 HSCEI FUTURES FEB18	359
OHHIG8-C1: HSCEI	22
OHHIG8-C1: HSCEI	419
OHHIG8-P1: HSCEI	22
OHHIG8-P1: HSCEI	419

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,006

공시일	2018-02-07
기준일	2018-02-06

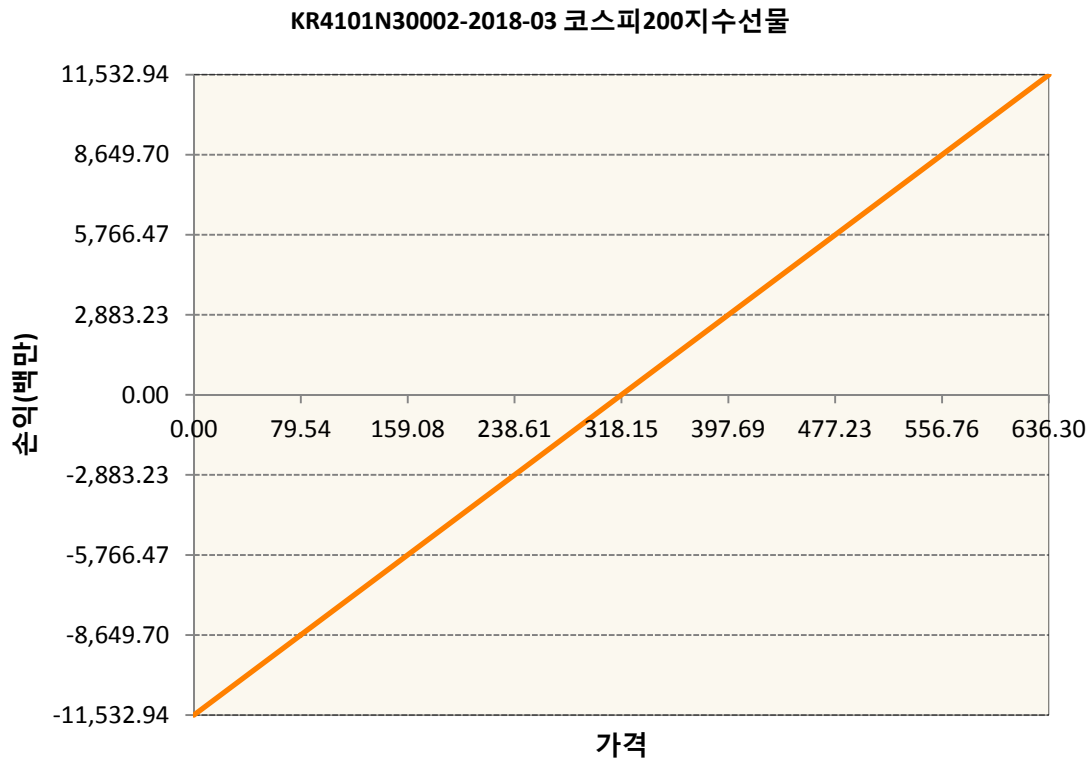
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

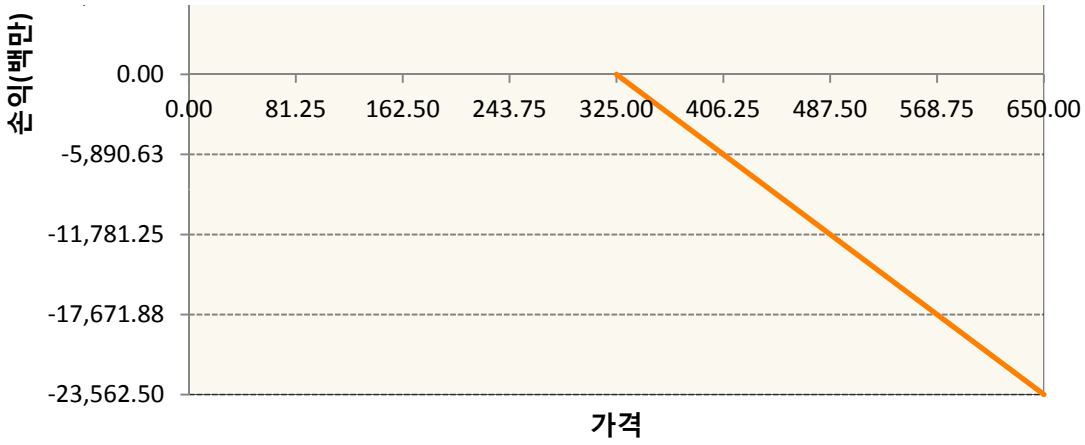
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,533	0	11,533	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,250	-60,250	장내

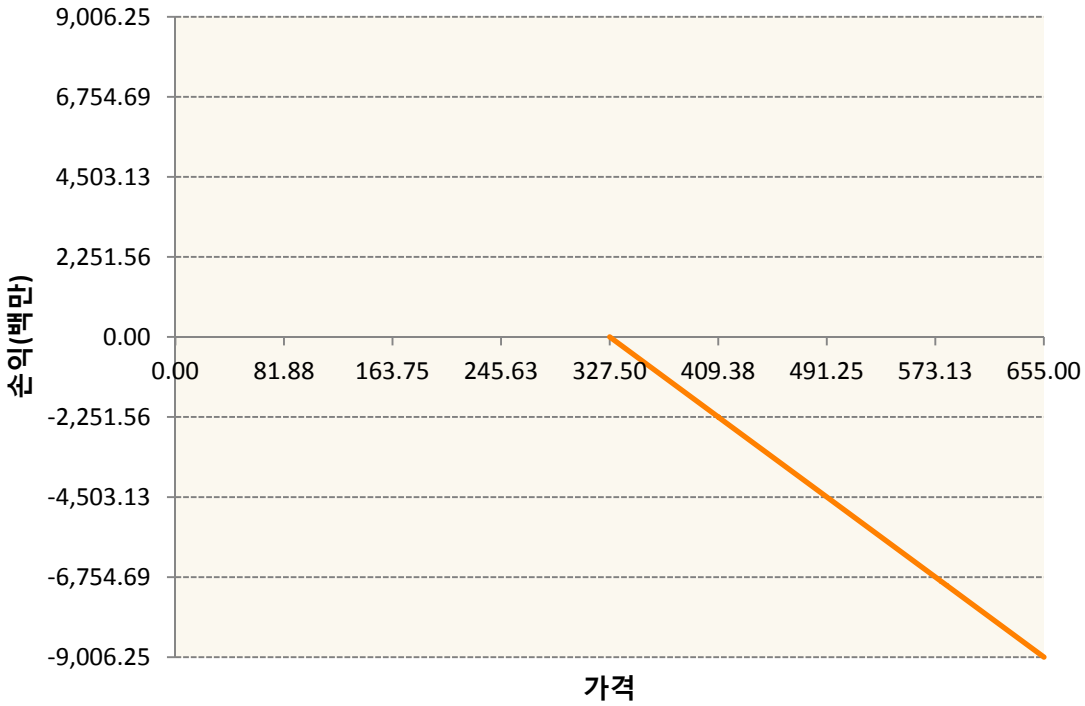
2. 만기시점의 손익구조



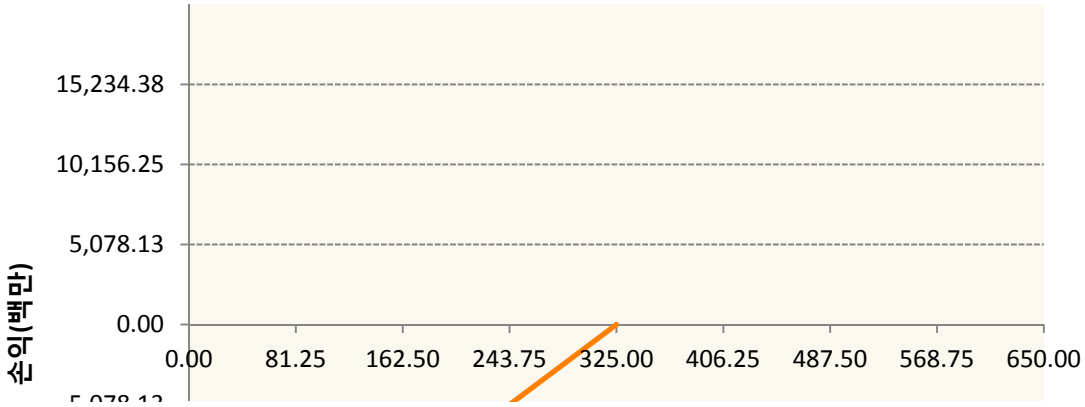




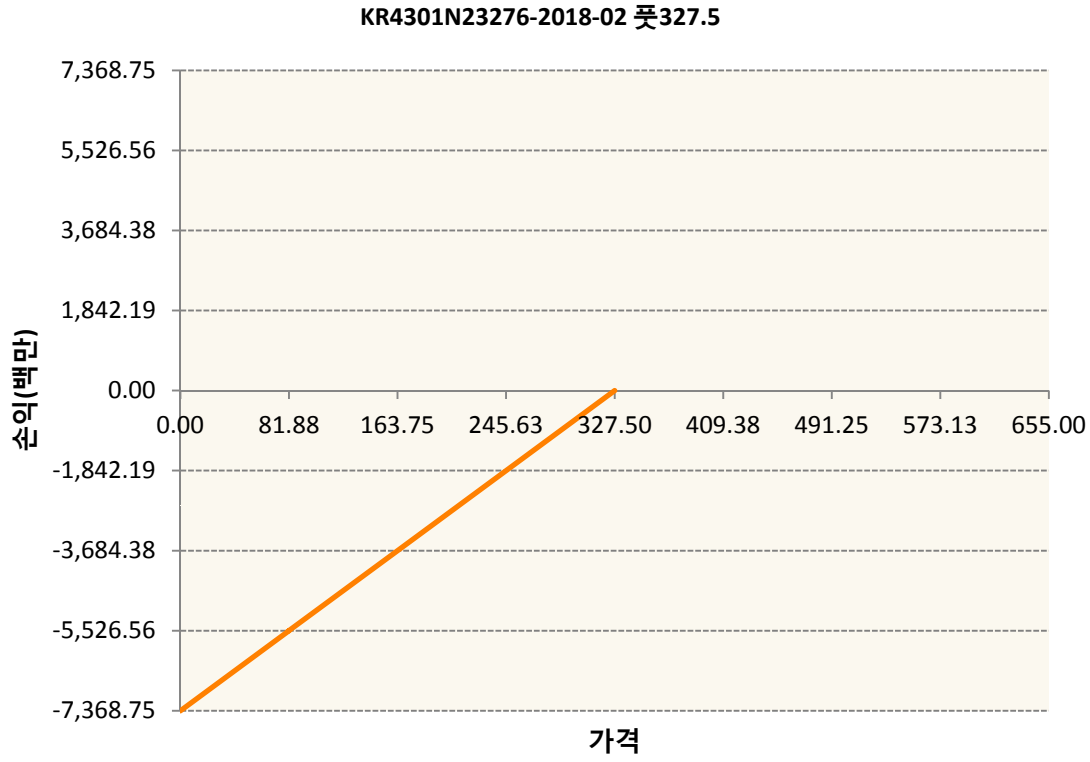
KR4201N23278-2018-02 콜327.5



KR4301N23250-2018-02 풋325







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,456
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456	-1,456
-5.33%	-970	-970	-970	-970	-970	-970	-970
-2.67%	-485	-485	-485	-485	-485	-485	-485
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	485	485	485	485	485	485	485
5.33%	970	970	970	970	970	970	970
8.00%	1,456	1,456	1,456	1,456	1,456	1,456	1,456
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							275
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
-5.33%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	275	275	275	275	275	275	275
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4						157
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-5.33%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	52	52	52	52	52	52	52
5.33%	105	105	105	105	105	105	105
8.00%	157	157	157	157	157	157	157
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5						236
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-236	-236	-236	-236	-236	-236	-236
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-2.67%	-79	-79	-79	-79	-79	-79	-79
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	79	79	79	79	79	79	79
5.33%	157	157	157	157	157	157	157
8.00%	236	236	236	236	236	236	236
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						197
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-197	-197	-197	-197	-197	-197	-197
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-2.67%	-66	-66	-66	-66	-66	-66	-66
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	66	66	66	66	66	66	66
5.33%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	197	197	197	197	197	197	197
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						252
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-252	-252	-252	-252	-252	-252	-252
-5.33%	-168	-168	-168	-168	-168	-168	-168
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	84	84	84	84	84	84	84
5.33%	168	168	168	168	168	168	168
8.00%	252	252	252	252	252	252	252
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						466
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-466	-466	-466	-466	-466	-466	-466
-5.33%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310
-2.67%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	155	155	155	155	155	155	155
5.33%	310	310	310	310	310	310	310
8.00%	466	466	466	466	466	466	466
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						310
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310
-5.33%	-207	-207	-207	-207	-207	-207	-207
-2.67%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	103	103	103	103	103	103	103
5.33%	207	207	207	207	207	207	207
8.00%	310	310	310	310	310	310	310
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						275
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
-5.33%	-184	-184	-184	-184	-184	-184	-184
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	184	184	184	184	184	184	184
8.00%	275	275	275	275	275	275	275
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						630
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-630	-630	-630	-630	-630	-630	-630
-5.33%	-420	-420	-420	-420	-420	-420	-420
-2.67%	-210	-210	-210	-210	-210	-210	-210
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	210	210	210	210	210	210	210
5.33%	420	420	420	420	420	420	420
8.00%	630	630	630	630	630	630	630
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						472

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-472	-472	-472	-472	-472	-472	-472
-5.33%	-315	-315	-315	-315	-315	-315	-315
-2.67%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	157	157	157	157	157	157	157
5.33%	315	315	315	315	315	315	315
8.00%	472	472	472	472	472	472	472
	KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물						922

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-922	-922	-922	-922	-922	-922	-922
-5.33%	-615	-615	-615	-615	-615	-615	-615
-2.67%	-307	-307	-307	-307	-307	-307	-307
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	307	307	307	307	307	307	307
5.33%	615	615	615	615	615	615	615
8.00%	922	922	922	922	922	922	922
	KR4201N232 2018-02 콜325						1,311

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	29	29	29	29	29	29	29
-5.33%	29	29	29	29	29	29	29
-2.67%	29	29	29	29	28	27	25
0%	20	14	8	0	-8	-17	-27
2.67%	-168	-183	-197	-212	-227	-242	-256
5.33%	-696	-698	-701	-706	-710	-716	-723
8.00%	-1,309	-1,309	-1,309	-1,309	-1,309	-1,310	-1,311
	KR4201N232 2018-02 콜327.5						436

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	5	5	5	5	5	5	5
-5.33%	5	5	5	5	5	5	5
-2.67%	5	5	5	5	5	4	4
0%	4	3	2	0	-2	-4	-7
2.67%	-35	-40	-46	-52	-57	-63	-69
5.33%	-204	-206	-209	-211	-214	-218	-222
8.00%	-434	-434	-434	-434	-435	-435	-436
	KR4301N232 2018-02 풋325						1,584

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,584	-1,584	-1,584	-1,584	-1,584	-1,584	-1,584
-5.33%	-1,054	-1,054	-1,054	-1,054	-1,054	-1,054	-1,054

-2.67%	-524	-524	-524	-524	-524	-524	-524
0%	5	4	2	0	-3	-6	-9
2.67%	399	391	382	374	365	357	348
5.33%	442	442	442	441	440	439	438
8.00%	442	442	442	442	442	442	442
	KR4301N232 2018-02 풋327.5						572
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-572	-572	-572	-572	-572	-572	-572
-5.33%	-381	-381	-381	-381	-381	-381	-381
-2.67%	-190	-190	-190	-190	-190	-190	-190
0%	0	0	0	0	0	-1	-1
2.67%	172	169	165	162	159	156	153
5.33%	214	213	213	212	211	210	209
8.00%	214	214	214	214	214	214	214

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

9,488

공시일	2018-02-07
기준일	2018-02-06

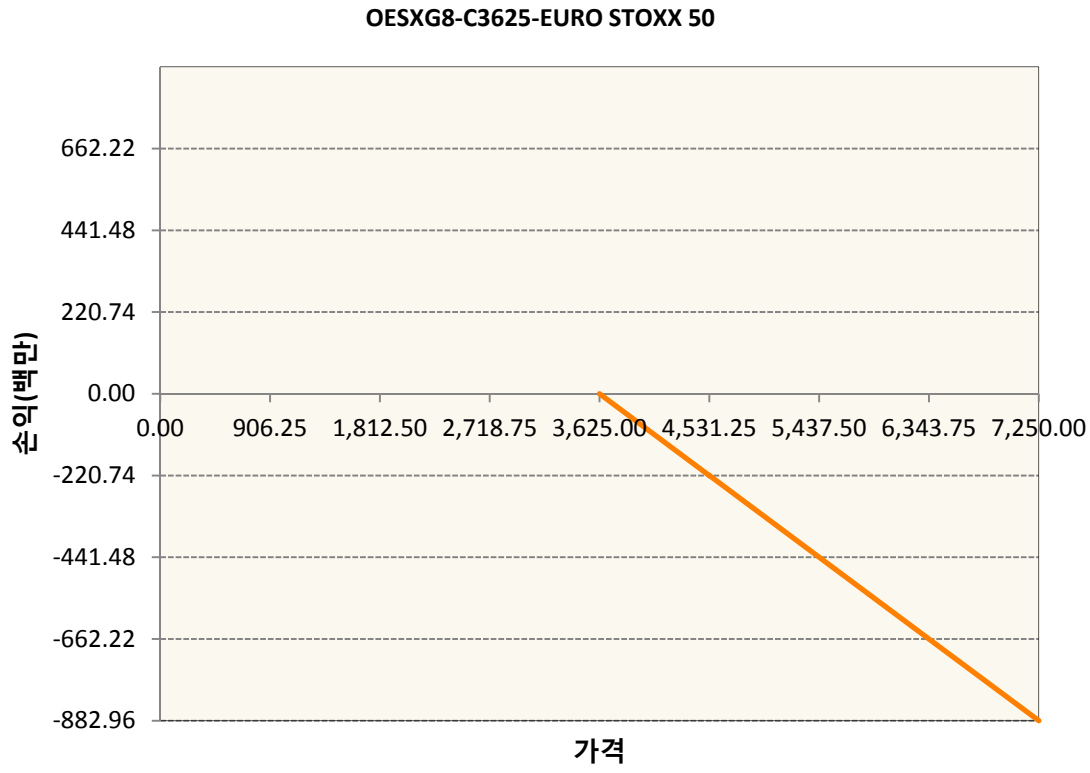
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

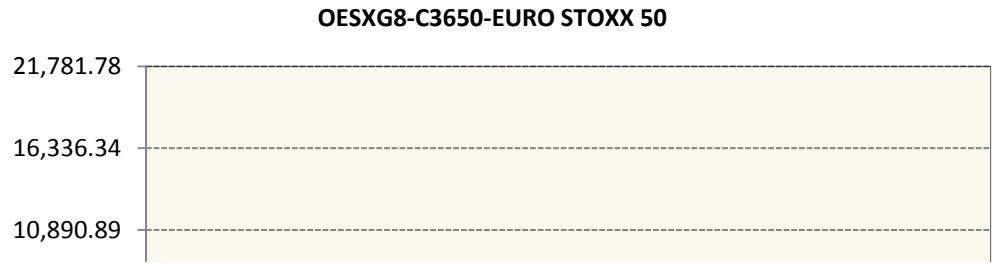
1. 계약금액

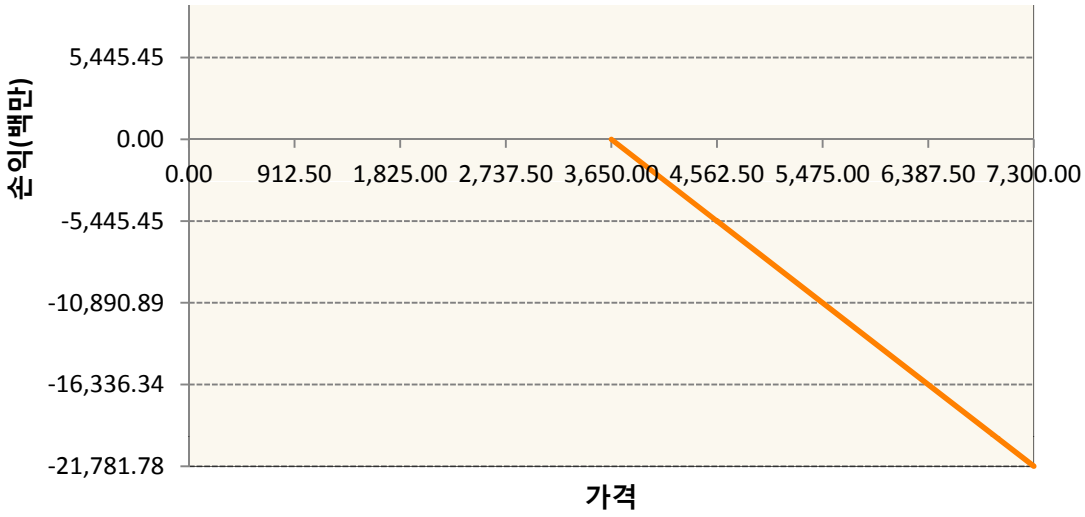
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	12,544	0	12,544	
누계	유가증권	스왑	101,489	0	101,489	장외
누계	유가증권	옵션	0	45,329	-45,329	장내
누계	지수	스왑	54,128	0	54,128	장외

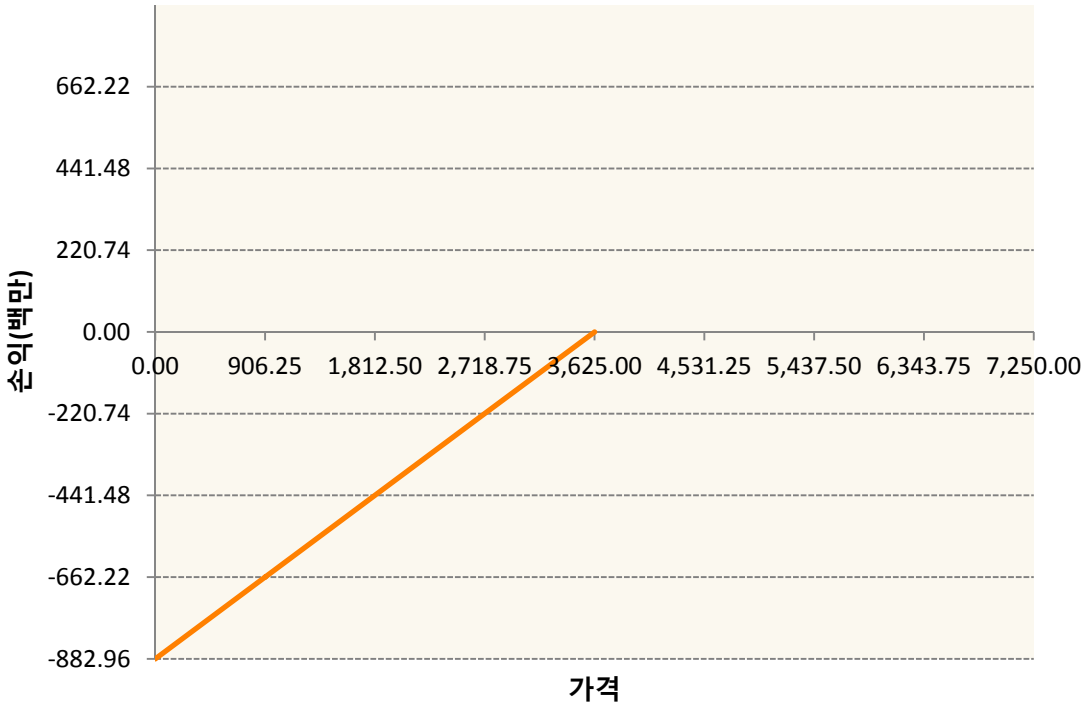
2. 만기시점의 손익구조



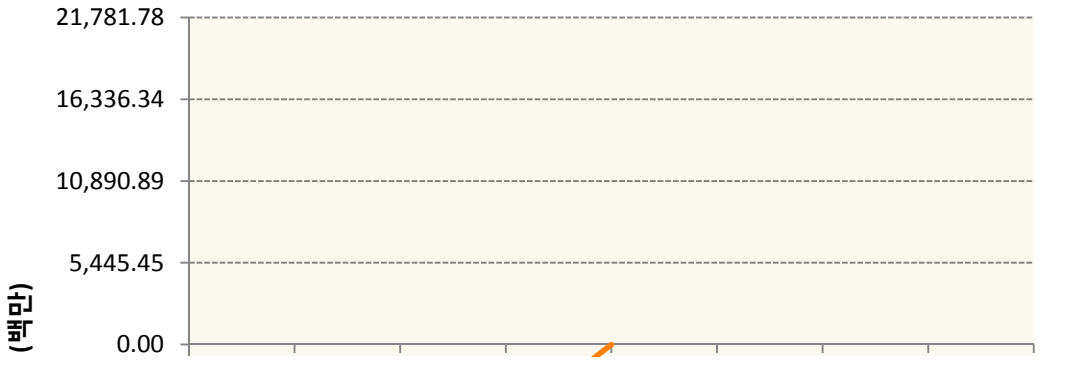


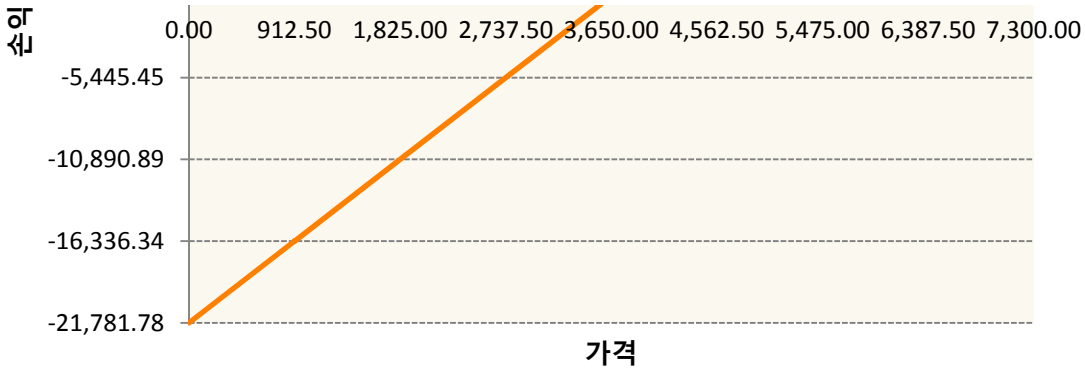


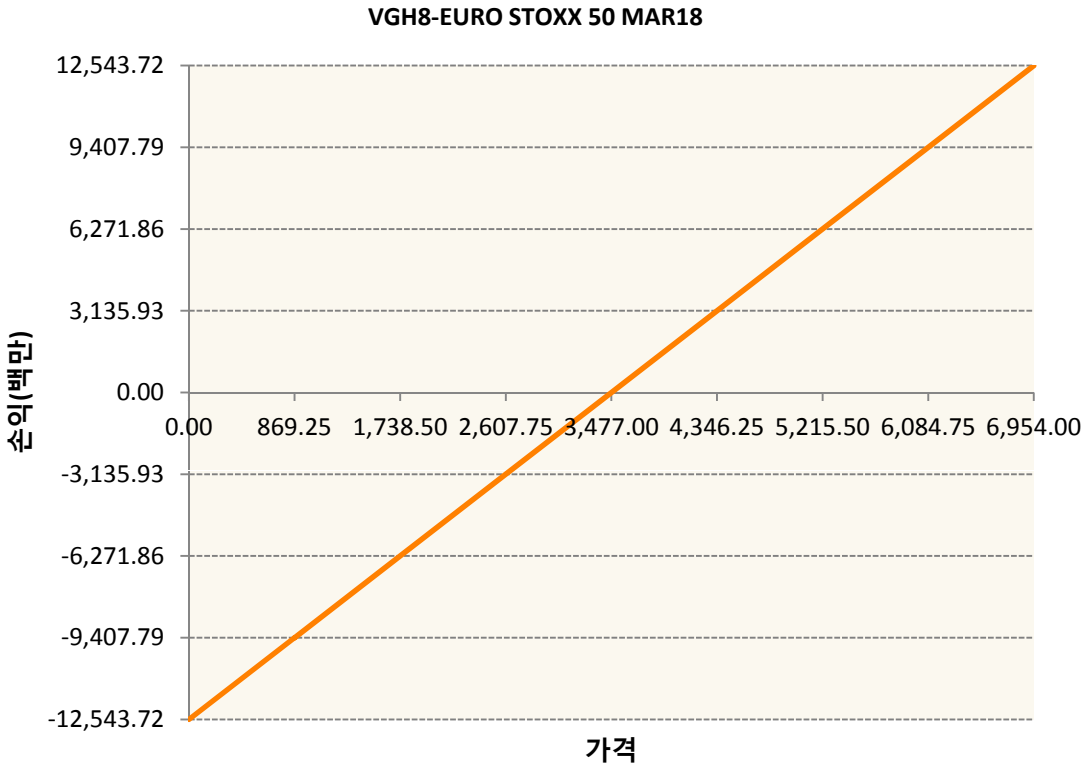
OESXG8-P3625-EURO STOXX 50



OESXG8-P3650-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	160
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	300
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	71
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	1,743
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	71
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	1,743
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,003

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)

2,837

공시일	2018-02-07
기준일	2018-02-06

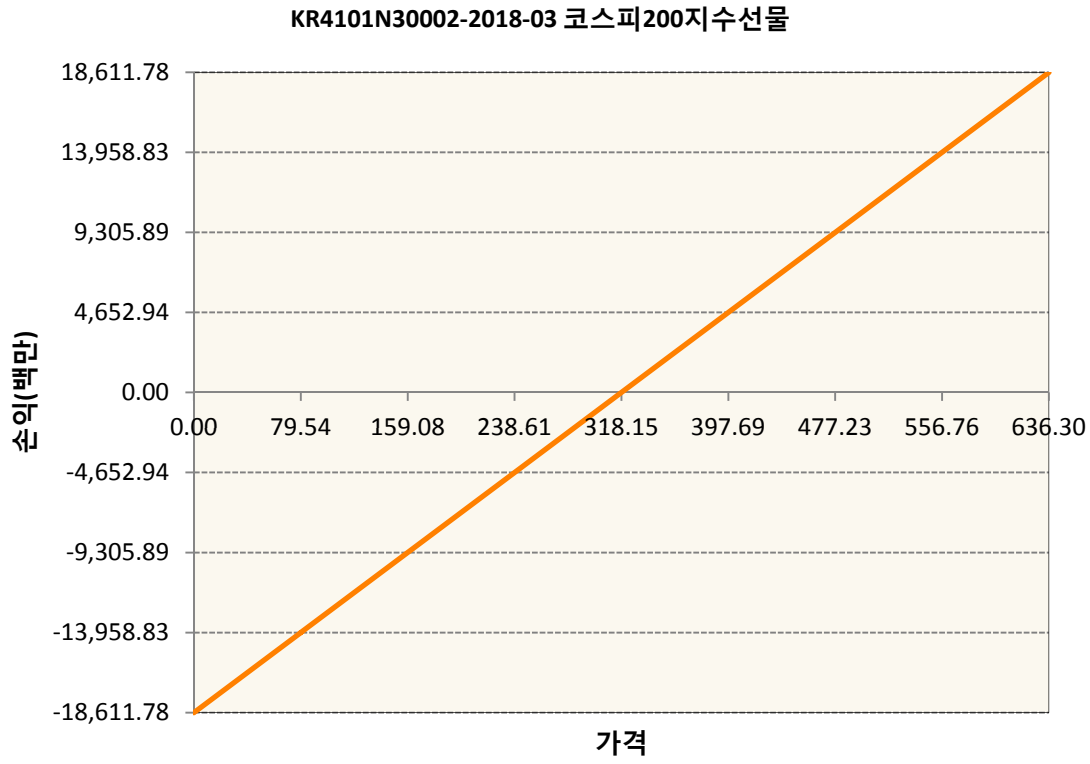
ETF스마트레버리지목표전환형8호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	18,612	0	18,612	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,488
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,488	-1,488	-1,488	-1,488	-1,488	-1,488	-1,488
-5.33%	-992	-992	-992	-992	-992	-992	-992
-2.67%	-496	-496	-496	-496	-496	-496	-496
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	496	496	496	496	496	496	496
5.33%	992	992	992	992	992	992	992
8.00%	1,488	1,488	1,488	1,488	1,488	1,488	1,488

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

929

공시일	2018-02-07
기준일	2018-02-06

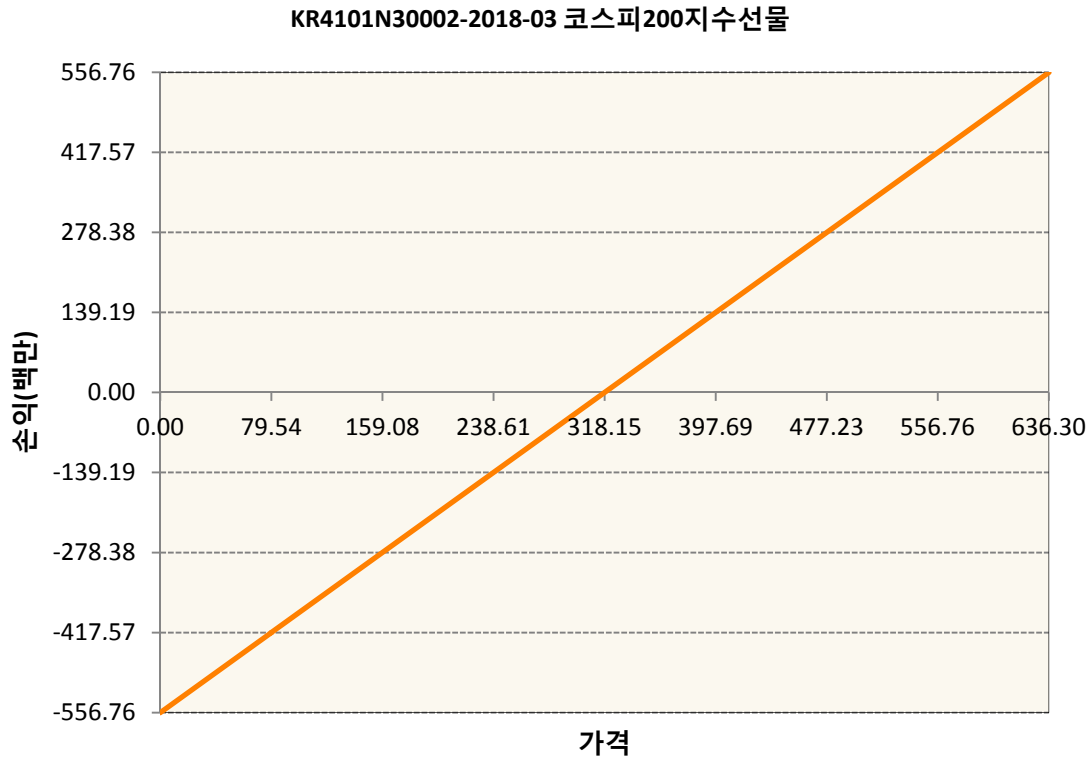
ETF스마트레버리지목표전환형9호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	557	0	557	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							45
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-45	-45	-45	-45	-45	-45	-45
-5.33%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
-2.67%	-15	-15	-15	-15	-15	-15	-15
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	15	15	15	15	15	15	15
5.33%	30	30	30	30	30	30	30
8.00%	45	45	45	45	45	45	45

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

28

공시일	2018-02-07
기준일	2018-02-06

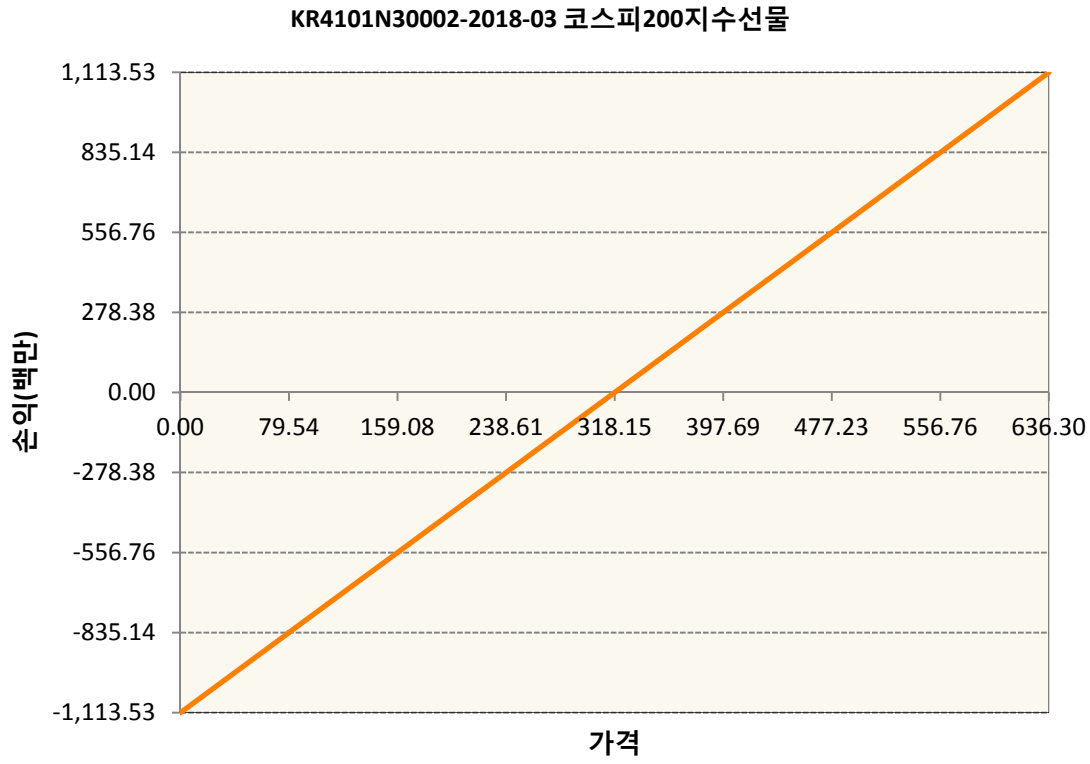
ETF스마트레버리지목표전환형10

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,114	0	1,114	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							89
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-89	-89	-89	-89	-89	-89	-89
-5.33%	-59	-59	-59	-59	-59	-59	-59
-2.67%	-30	-30	-30	-30	-30	-30	-30
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	30	30	30	30	30	30	30
5.33%	59	59	59	59	59	59	59
8.00%	89	89	89	89	89	89	89

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

56

공시일	2018-02-07
기준일	2018-02-06

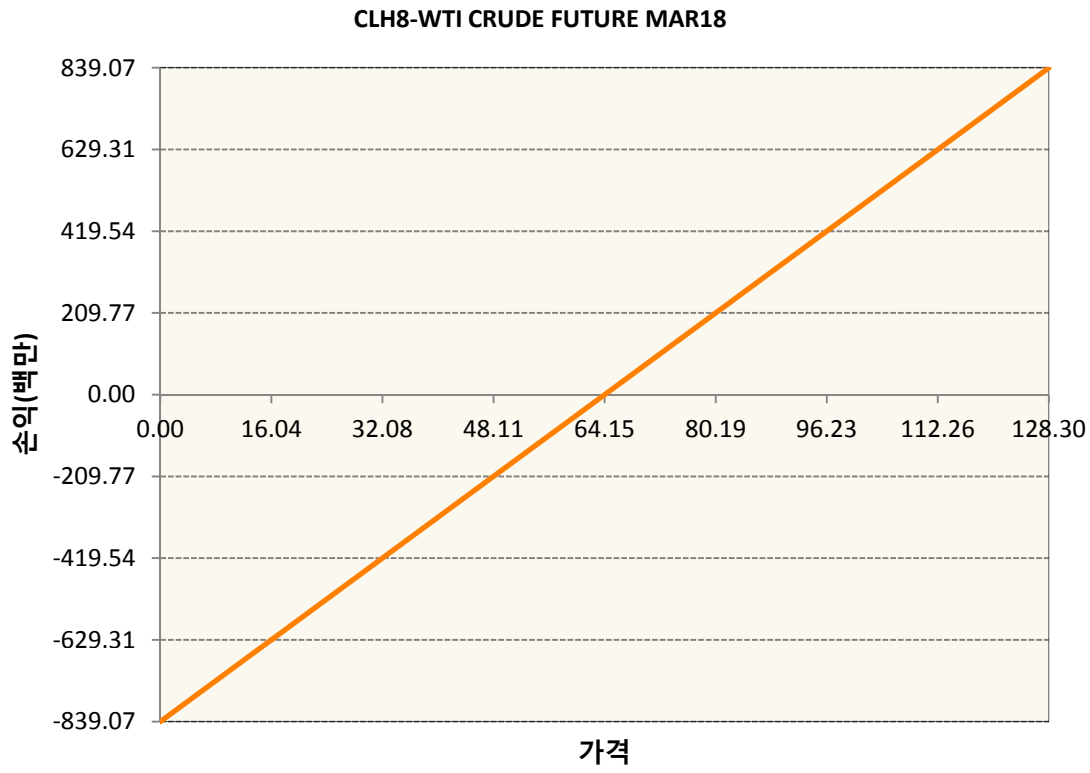
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

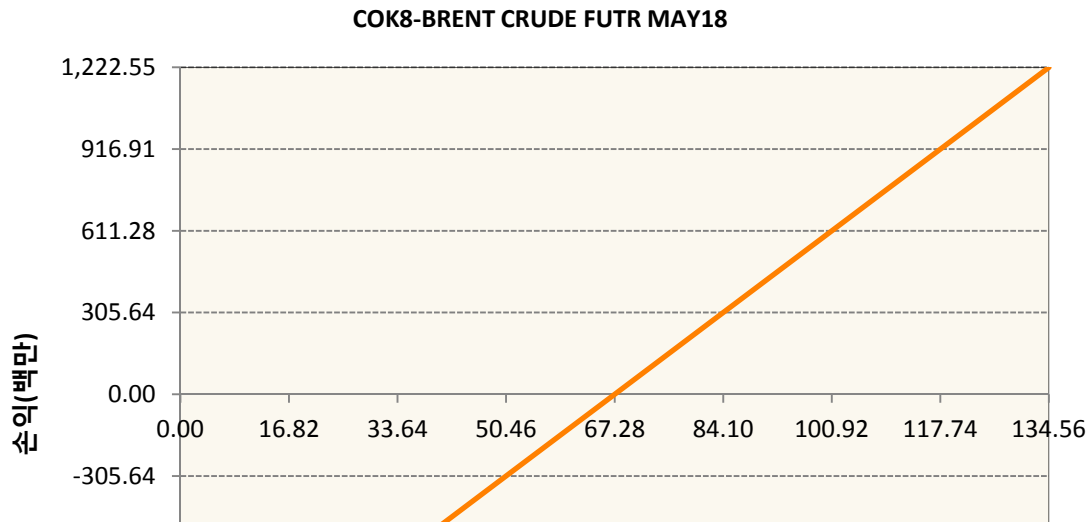
1. 계약금액

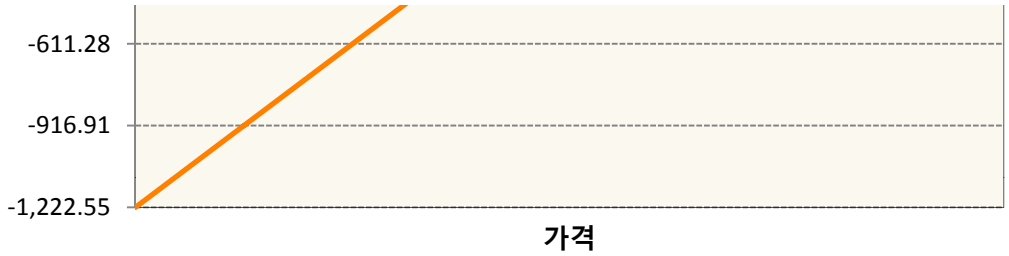
(단위:백만원)

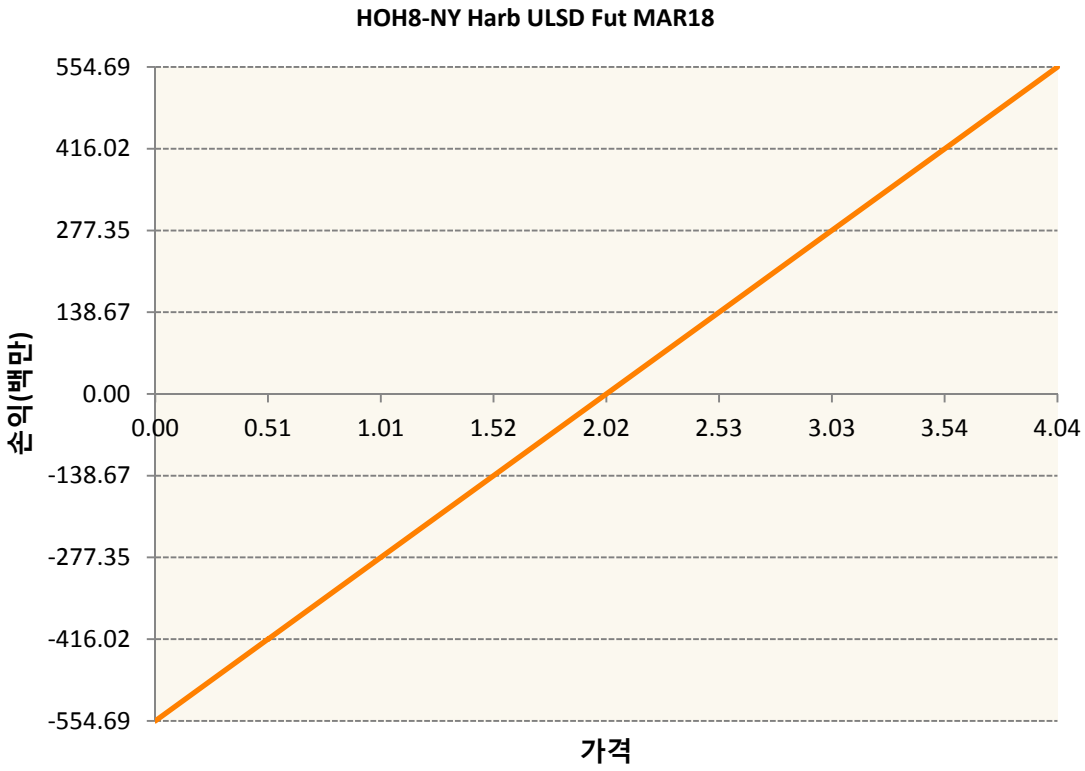
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,341	873	3,468	

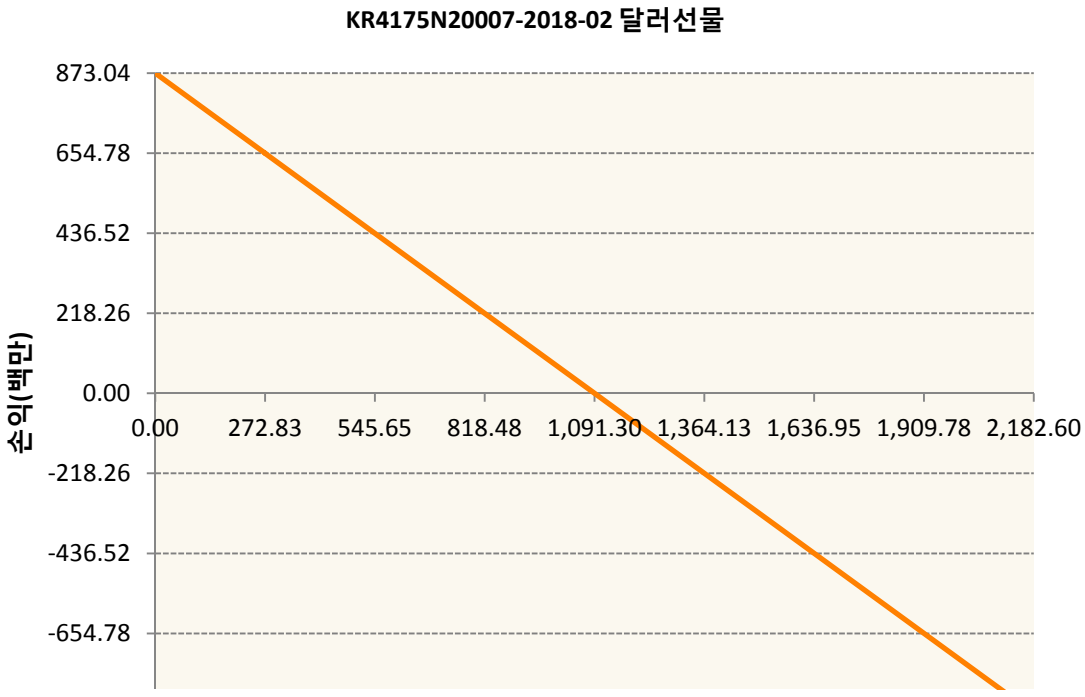
2. 만기시점의 손익구조

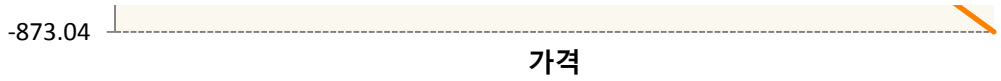


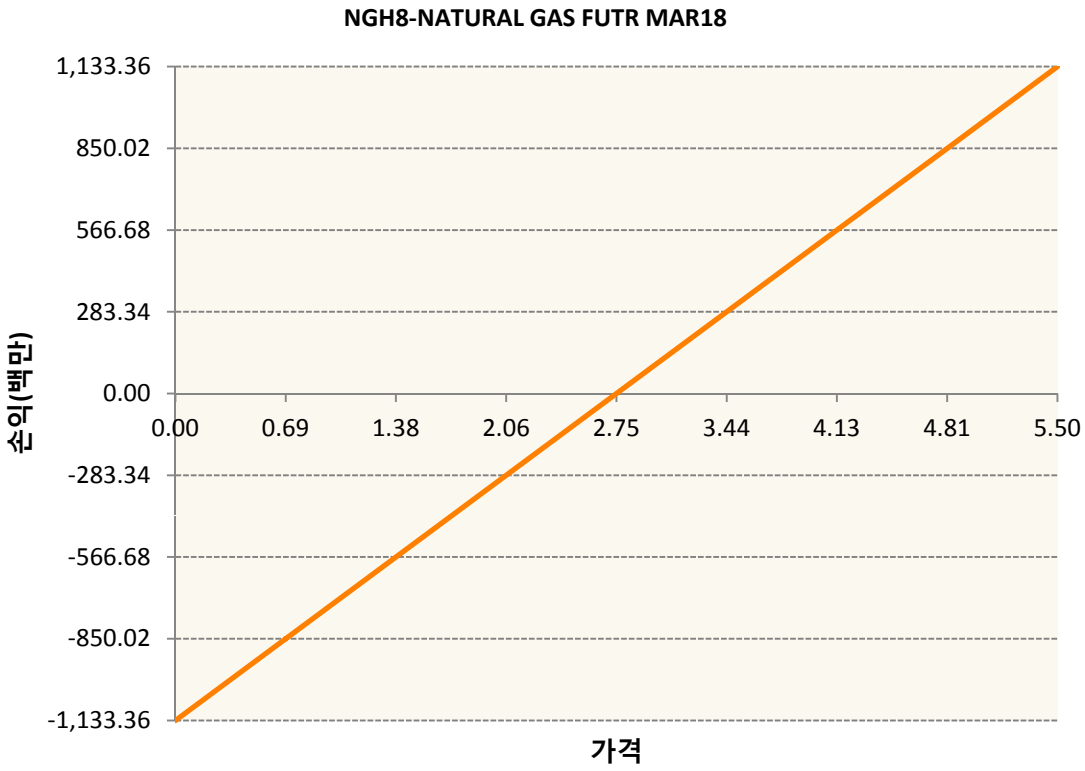


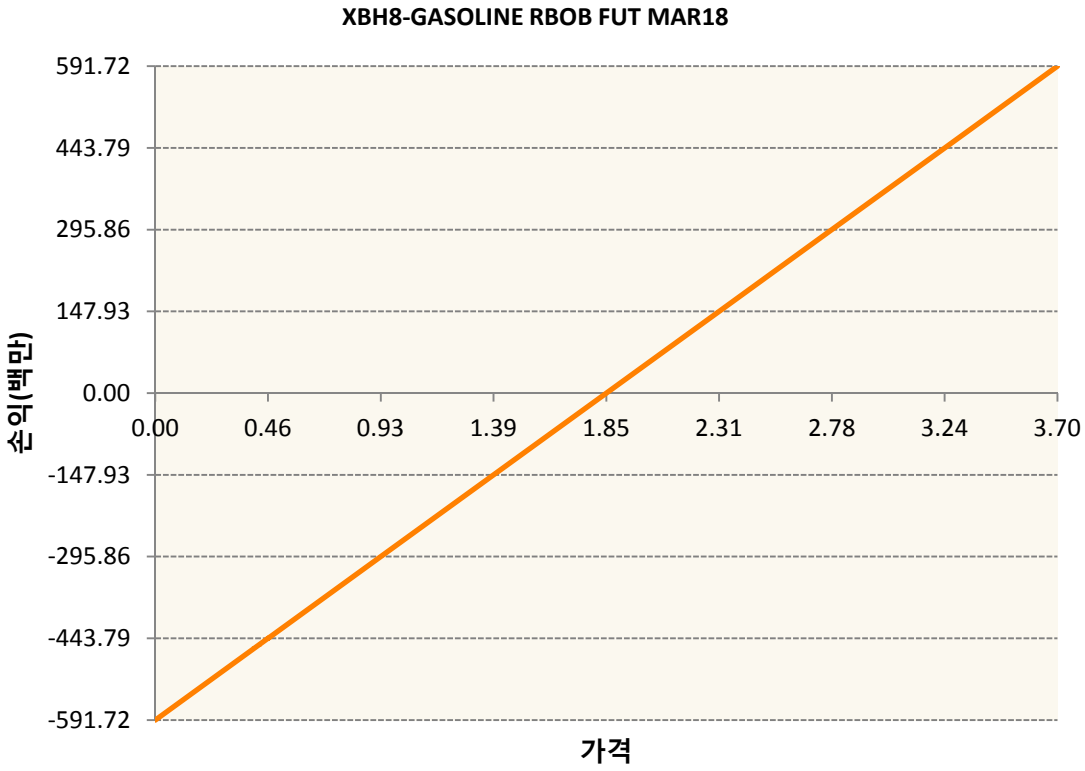

-611.28
-916.91
-1,222.55
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
554.69
416.02
277.35
138.67
0.00
-138.67
-277.35
-416.02
-554.69
0.00
0.51
1.01
1.52
2.02
2.53
3.03
3.54
4.04
손익(백만)
가격


KR4175N20007-2018-02 달러선물
873.04
654.78
436.52
218.26
0.00
-218.26
-436.52
-654.78
0.00
272.83
545.65
818.48
1,091.30
1,364.13
1,636.95
1,909.78
2,182.60
손익(백만)


-873.04
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
1,133.36
850.02
566.68
283.34
0.00
-283.34
-566.68
-850.02
-1,133.36
0.00
0.69
1.38
2.06
2.75
3.44
4.13
4.81
5.50
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
591.72
443.79
295.86
147.93
0.00
-147.93
-295.86
-443.79
-591.72
0.00
0.46
0.93
1.39
1.85
2.31
2.78
3.24
3.70
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	67
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	98
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	44
KR4175N20(	2018-02 달러선물	70
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	91
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	47

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

589

공시일	2018-02-07
기준일	2018-02-06

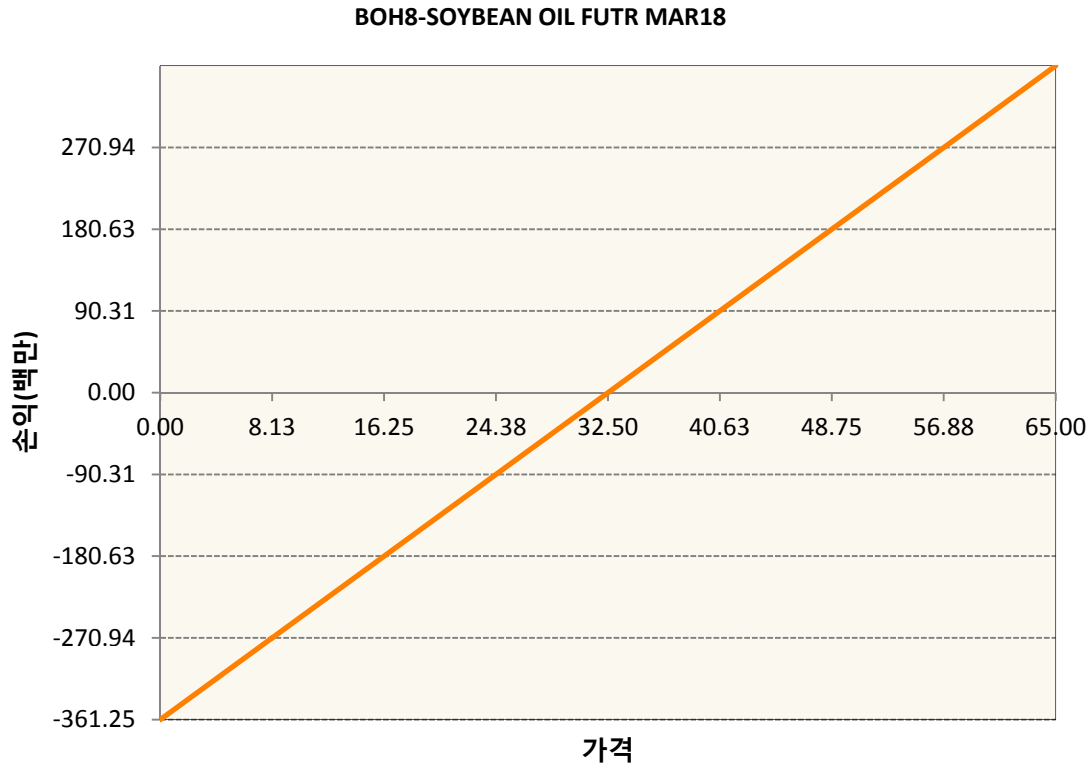
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

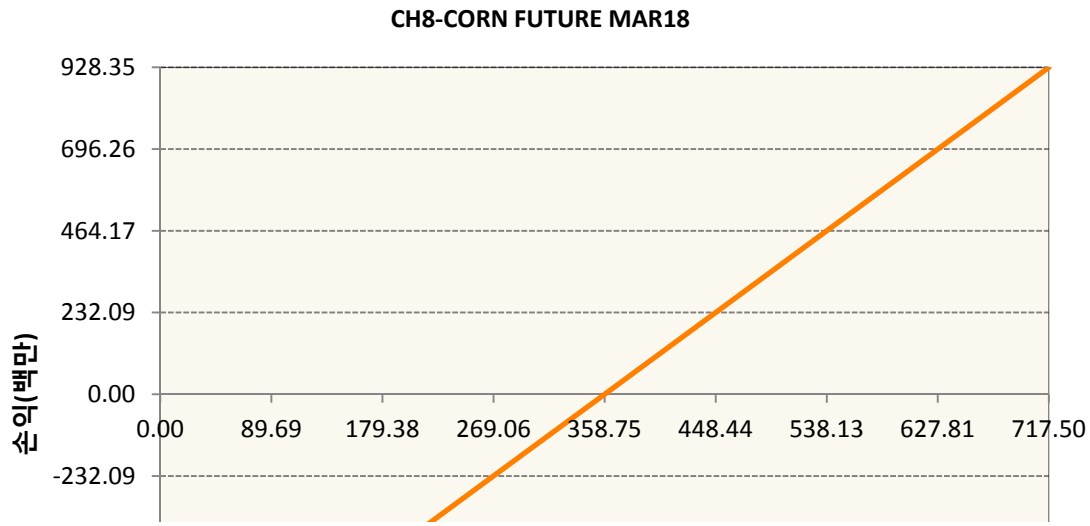
1. 계약금액

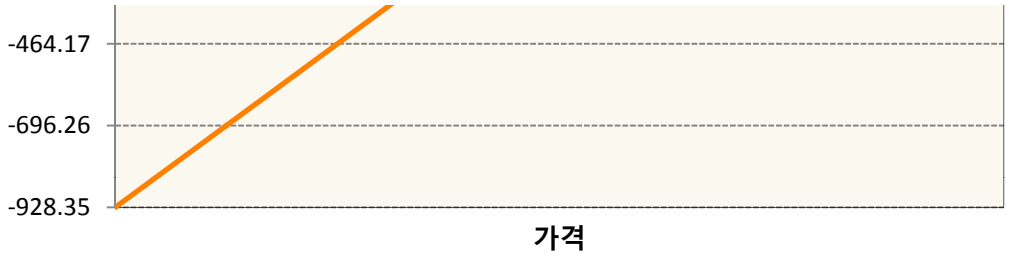
(단위:백만원)

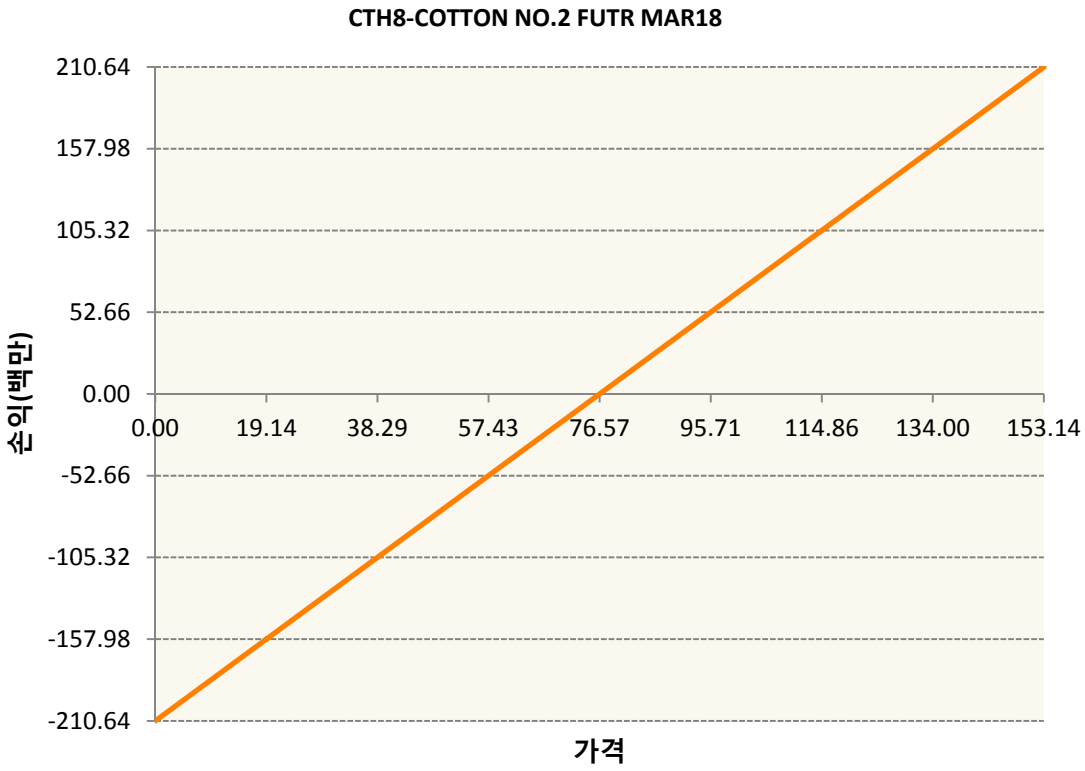
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,099	327	3,771	

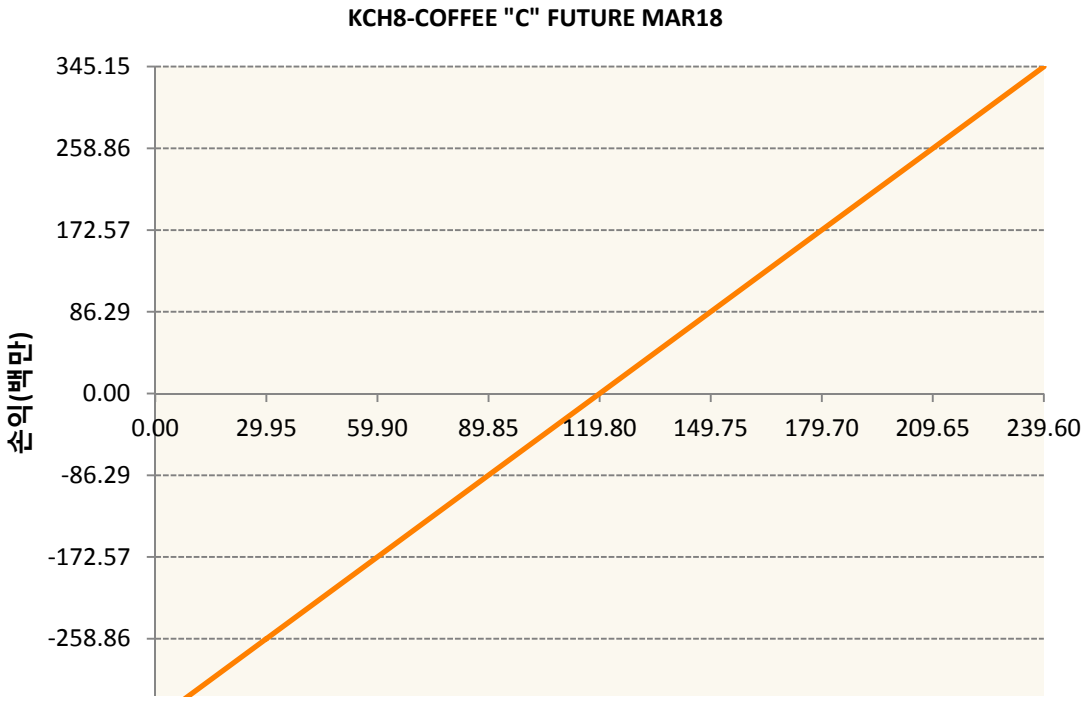
2. 만기시점의 손익구조

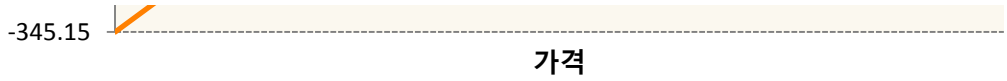


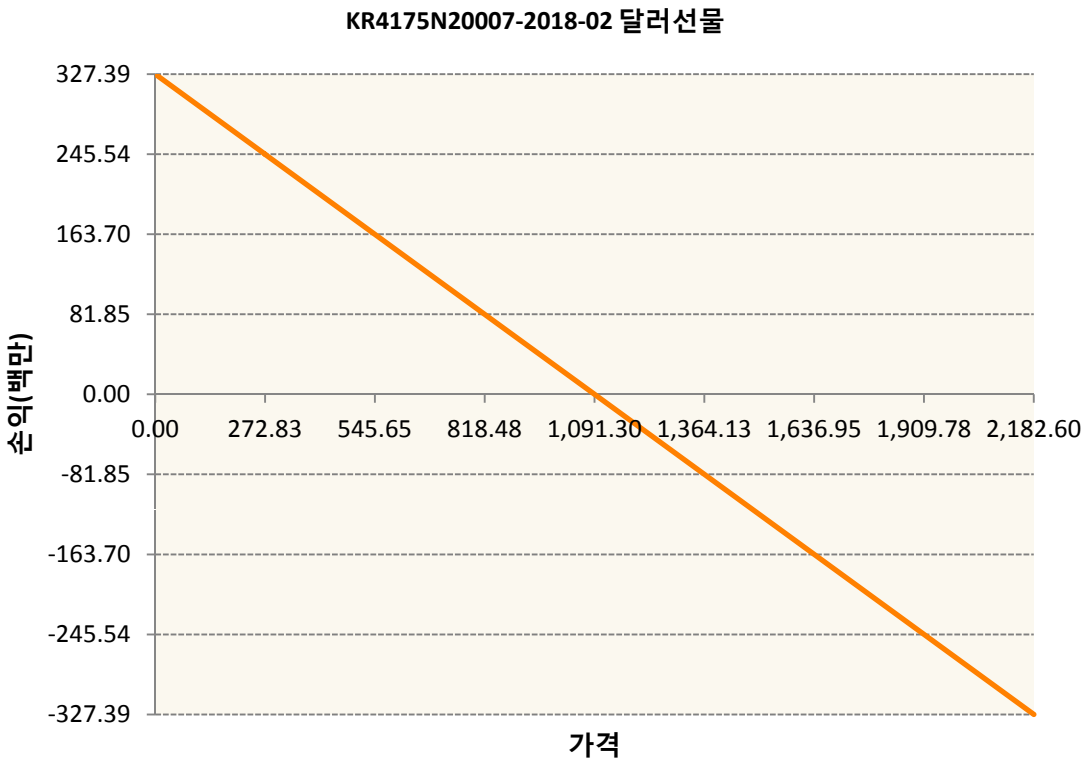


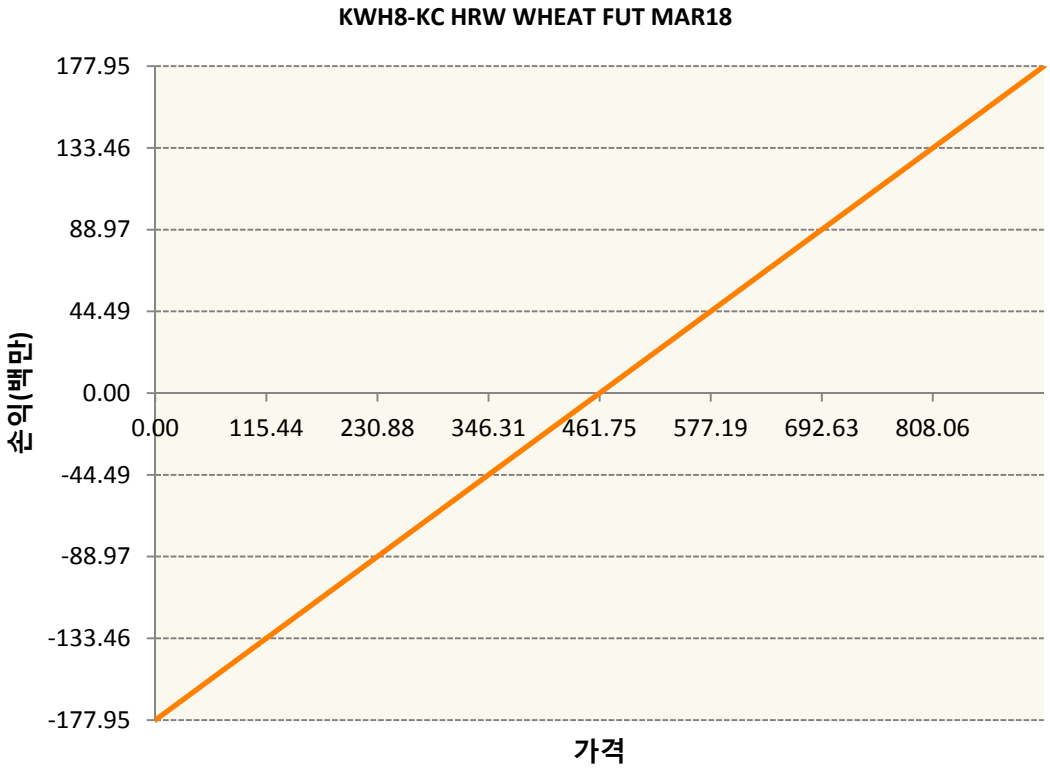

-464.17
-696.26
-928.35
가격

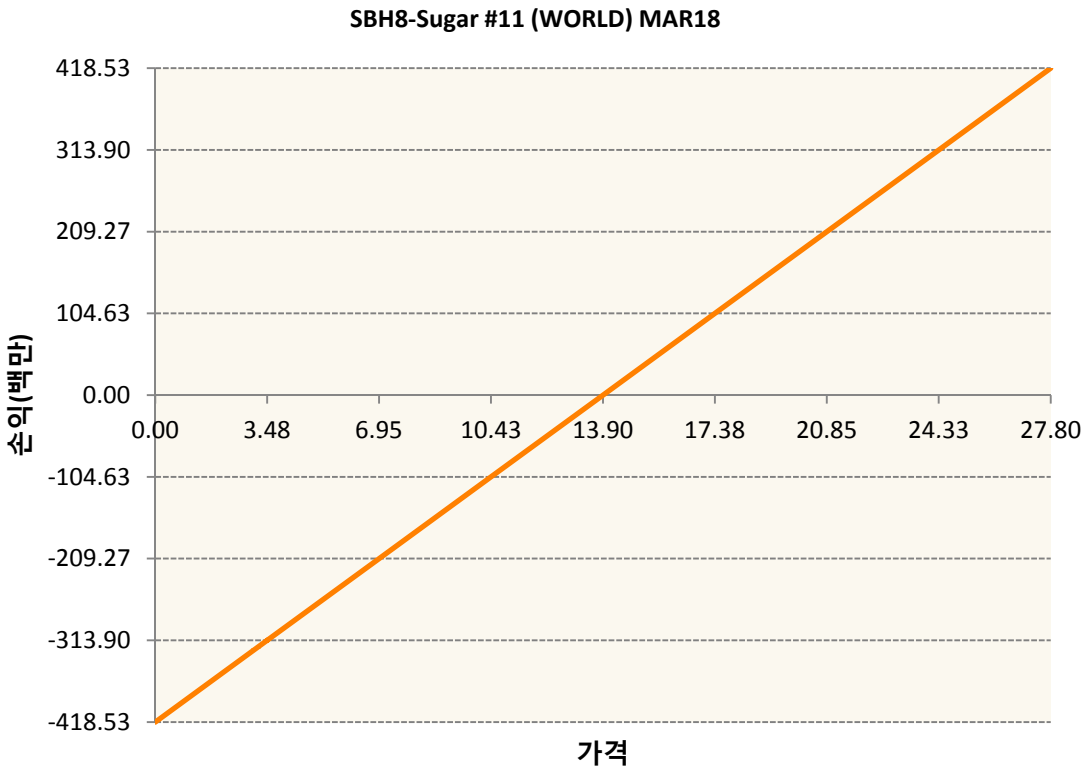

CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
210.64
157.98
105.32
52.66
0.00
-52.66
-105.32
-157.98
-210.64
0.00
19.14
38.29
57.43
76.57
95.71
114.86
134.00
153.14
손익(백만)
가격

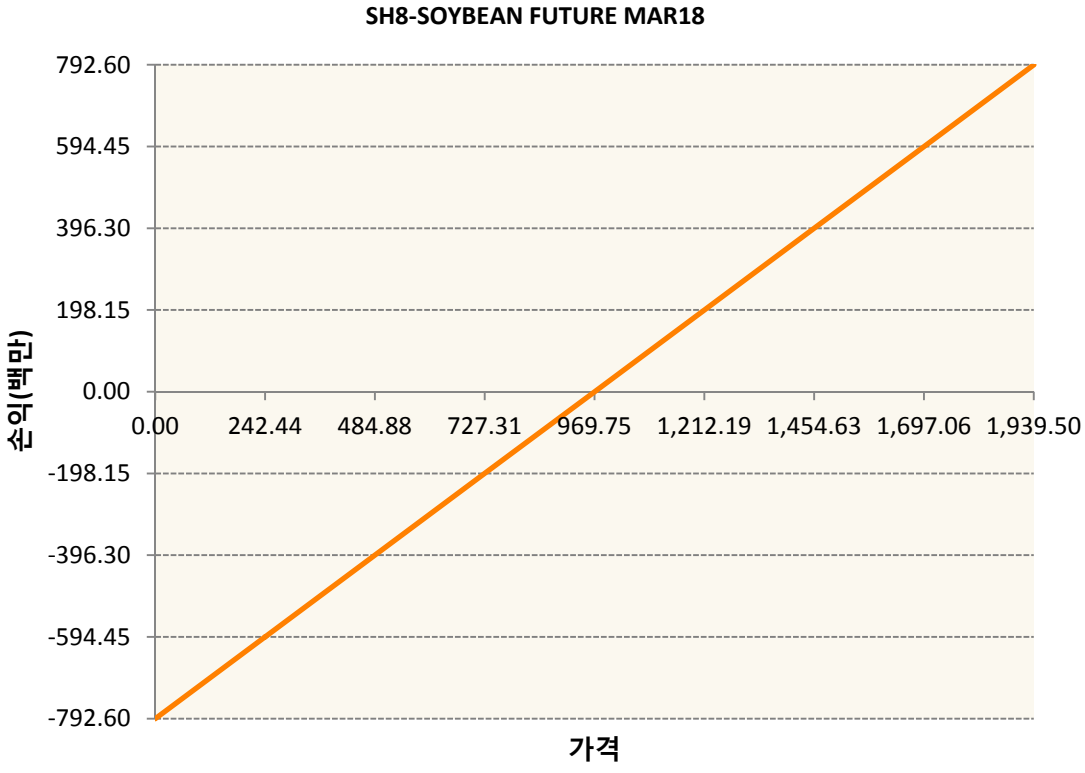

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
345.15
258.86
172.57
86.29
0.00
-86.29
-172.57
-258.86
0.00
29.95
59.90
89.85
119.80
149.75
179.70
209.65
239.60
손익(백만)


-345.15
가격

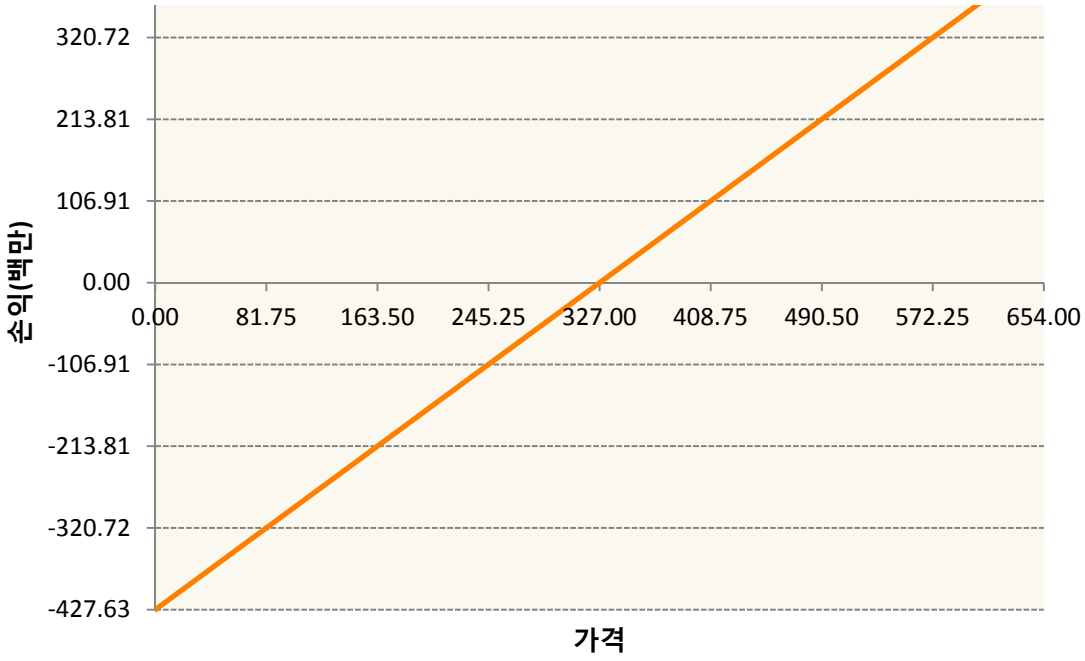

KR4175N20007-2018-02 달러선물
327.39
245.54
163.70
81.85
0.00
-81.85
-163.70
-245.54
-327.39
0.00
272.83
545.65
818.48
1,091.30
1,364.13
1,636.95
1,909.78
2,182.60
손익(백만)
가격


KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
177.95
133.46
88.97
44.49
0.00
-44.49
-88.97
-133.46
-177.95
0.00
115.44
230.88
346.31
461.75
577.19
692.63
808.06
손익(백만)
가격

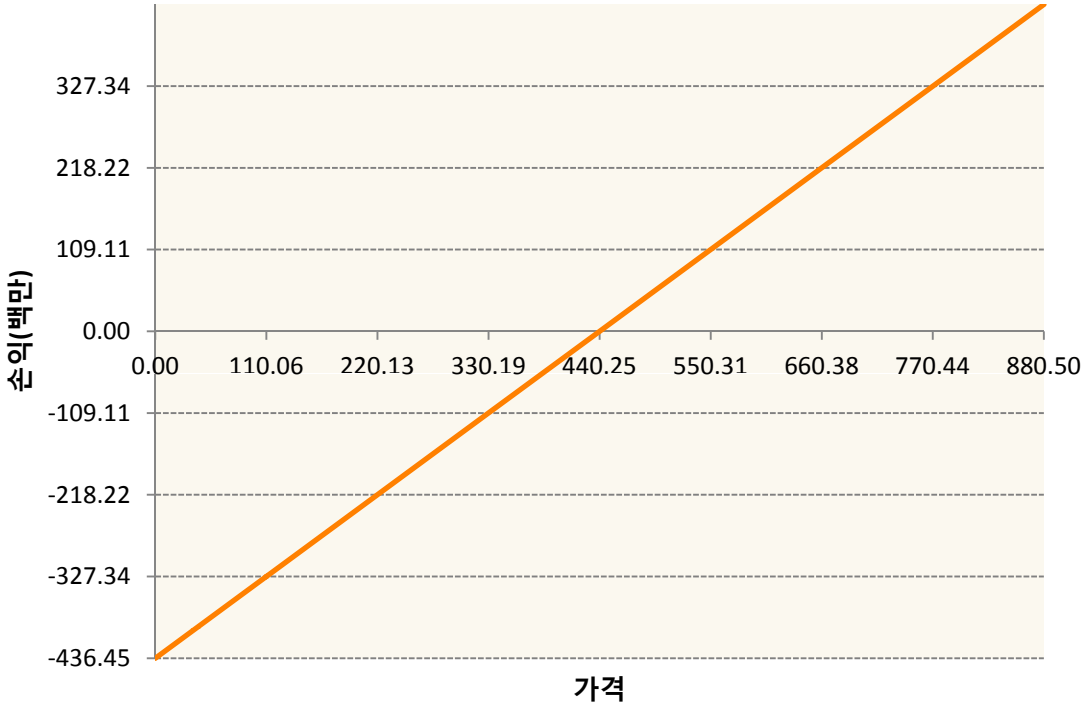

SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
418.53
313.90
209.27
104.63
0.00
-104.63
-209.27
-313.90
-418.53
0.00
3.48
6.95
10.43
13.90
17.38
20.85
24.33
27.80
손익(백만)
가격


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18
792.60
594.45
396.30
198.15
0.00
-198.15
-396.30
-594.45
-792.60
0.00
242.44
484.88
727.31
969.75
1,212.19
1,454.63
1,697.06
1,939.50
손익(백만)
가격


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18
427.63



WH8-WHEAT FUTURE(CBT) MAR18



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	29
CH8	CORN FUTURE MAR18	74
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	17
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	28
KR4175N20(	2018-02 달러선물	26

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	14
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	33
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	63
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	34
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	35

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

340